



PORTEFEUILLE DU FRR AU 31 DECEMBRE 2012

ACTIONS	
Valeur boursière de la poche	7 218 607 077 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
CHALLENGER DIV	33 689	66 057 €
361 DEGREES INTL	124 000	26 939 €
3I GROUP	159 500	427 116 €
3M	17 408	1 225 981 €
A2A	1 575 060	688 774 €
AAC TECHNO HOLD NV	184 000	487 968 €
AAREAL BANK	127 500	2 003 025 €
ABACUS PROPERTY	65 014	110 584 €
ABB LTD NOM,	19 934	309 714 €
ABBOTT LABO,	334 931	16 639 852 €
ABCAM	735 087	3 491 459 €
ABERCROMBIE CL,A	3 980	144 812 €
ABERDEEN ASSET	2 000 000	9 051 905 €
ABERTIS INFRAES,A	258 927	3 215 873 €
ACADIA REALTY TRUST	7 712	146 706 €
ACCENTURE PLC-CL	42 073	2 122 159 €
ACCIONA	20 267	1 139 208 €
ACCOR	157 258	4 198 002 €
ACCORDIA GOLF	391	275 758 €
ACE NOM,	62 887	3 806 419 €
ACERGY	148 333	2 670 609 €
ACERINOX	184 623	1 541 233 €
ACRUX LIMITED	32 487	72 910 €
ACS ACT,CONSTR,	173 550	3 304 392 €
ACTELION	65 639	2 367 638 €
ACTIVISION	284 960	2 295 415 €
ADECCO NOM,	11 276	448 872 €
ADELAIDE BRIGHTON	95 139	233 746 €
ADIDAS NOM,	189 584	12 764 691 €
ADMIRAL GROUP	129 616	1 853 712 €
ADOBE SYSTEMS	29 456	841 855 €
ADP (PROMESSE)	42 646	2 489 247 €
ADT CORP	8 186	288 658 €
ADVANCE AUTO PARTS	7 734	424 420 €
ADVANCE RESIDENCE	185	287 399 €
ADVANCED MICRO ORD	61 420	111 808 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
AED OIL LTD	34 369	3 924 €
AEGIS GROUP	797 506	2 308 648 €
AEGON	1 334 472	6 409 469 €
AEON CREDIT SCE,	86 600	1 321 789 €
AEON MALL	81 987	1 521 794 €
AES	25 935	210 486 €
AETNA	20 645	725 174 €
AF AB-B	263 037	4 768 941 €
AFFINE	1 569	19 785 €
AFLAC	12 749	513 673 €
AFRICAN BARRICK GO	113 485	616 465 €
AGCO	128 800	4 798 738 €
AGEAS	169 508	3 765 620 €
AGGREKO	100 764	2 161 624 €
AGILE PROPERTY	533 186	568 735 €
AGILENT TECHN,	73 185	2 272 599 €
AGL ENERGY	111 263	1 347 527 €
AGNICO EAGLE MINES	50 350	1 999 501 €
AGREE REALTY	3 589	72 929 €
AGRIUM	5 134	387 739 €
AIA GROUP LTD	3 108 769	9 202 762 €
AIDA ENGINEERING	110 500	658 154 €
AIMS AMP	86 400	80 204 €
AIR FRANCE	139 787	978 369 €
AIR LIQUIDE	166 994	15 872 780 €
AIR LIQUIDE PRIME	109 101	10 370 050 €
AIR N,ZEALAND	56 516	45 797 €
AIR PRODUCTS	6 149	391 868 €
AIRGAS	8 178	566 269 €
AISIN SEIKI	79 100	1 848 442 €
AIXTRON AG	87 700	778 688 €
AJ LUCAS GROUP	9 957	9 958 €
AJINOMOTO CO	50 000	501 316 €
AJISEN CHINA	86 000	62 278 €
AKAMAI TECHN,	20 472	635 247 €
AKER SOLUTIONS	74 723	1 149 788 €
AKZO NOBEL	159 523	7 935 472 €
ALCATEL A	1 902 797	1 908 505 €
ALCOA	39 643	260 999 €
ALESCO CORP	14 840	18 990 €
ALEXANDER S	365	91 582 €
ALEXANDRIA REAL	11 600	609 915 €
ALEXION PHARMA, INC	6 559	466 354 €
ALFA LAVAL	20 413	322 017 €
ALIM,COUCHE SUB,	7 292	271 804 €
ALLEGHANY	6 592	1 677 100 €
ALLEGHENY TECHN,	8 888	204 672 €
ALLERGAN	38 286	2 663 816 €
ALLIANCE DATA SYS,	2 514	276 037 €
ALLIANT ENERGY	5 651	188 210 €
ALLIANZ	298 161	31 247 273 €
ALLIED PROPERTIES	9 525	239 449 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
ALLREAL HOLDING	1 454	170 003 €
ALLSTATE	20 454	623 208 €
ALPHA BANK	532 652	767 019 €
ALPHA NAT,RES,	4 904	36 229 €
ALS LTD	68 816	585 253 €
ALSTOM REGROUPT	277 408	8 359 690 €
ALSTRIA OFF,REIT	13 445	124 380 €
ALTERA	85 430	2 228 411 €
ALTRIA GROUP	164 992	3 934 579 €
ALUMINA	486 760	344 975 €
AMADEUS IT HOLDING	267 287	5 091 817 €
AMAZON COM	9 705	1 846 703 €
AMCOR	244 651	1 554 716 €
AMDOCS	33 972	875 841 €
AMEC	315 118	3 896 725 €
AMER,ELECT,POWER	138 590	4 486 515 €
AMEREN	18 491	430 858 €
AMERI TOWER NV	59 423	3 482 718 €
AMERICAN ASSETS TR	7 099	150 391 €
AMERICAN CAMPUS	18 925	662 174 €
AMERICAN CAPITAL	153 285	3 360 085 €
AMERICAN EAGLE	19 679	306 141 €
AMERICAN EXPRESS	77 647	3 385 277 €
AMERICAN INTL GRP	37 253	997 445 €
AMERICAN WATER WKS	6 733	189 621 €
AMERIPRISE FCIAL	122 985	5 842 347 €
AMERISOURCEBERGEN	166 122	5 440 798 €
AMERN REALTY CAP	35 064	306 916 €
AMETEK INC	218 094	6 214 951 €
AMGEN	174 336	11 398 485 €
AMLIN	542 779	2 536 225 €
AMP	588 778	2 230 114 €
AMP NZ OFFICE	147 842	91 586 €
AMPELLA MINING	39 347	9 295 €
AMPHENOL CL,A	6 218	305 146 €
AMVIG	76 000	21 048 €
ANADARKO PETROLE,	66 415	3 743 400 €
ANALOG DEVICES	180 149	5 747 168 €
ANDRITZ AG	257 762	12 511 767 €
ANF	1 675	40 535 €
ANGLO AMERICAN	18 518	432 414 €
ANGLO IRISH BANK	1 655 585	- €
ANNALY CAP,MGMT	402 403	4 285 299 €
ANRITSU	404 000	3 614 737 €
ANSELL	27 273	329 235 €
ANSYS	9 303	475 170 €
ANTA SPORTS	200 000	134 264 €
ANTOFAGASTA	227 598	3 715 199 €
ANXIN-CHINA HOLDIN	416 000	77 348 €
AON PLC	60 331	2 544 756 €
AP MOELLER MAERS,A	68	364 927 €
AP MOELLER MAERS,B	91	519 582 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
APA GROUP ST,SECU,	162 888	709 324 €
APAC RESOURCES	1 040 000	20 253 €
APACHE	91 363	5 439 924 €
APARTMENT INVEST,A	29 138	598 054 €
APERAM	59 922	683 710 €
API	39	185 421 €
APN NEWS AND MEDIA	35 892	7 066 €
APOLLO GROUP CL,A	21 830	346 392 €
APOLLO SOLAR ENERG	1 406 000	48 157 €
APPLE	132 809	53 608 427 €
APPLIED MATERIALS	36 923	320 388 €
AQUILLA RESOURCES	31 506	63 513 €
ARA ASSET MNGMT	74 800	75 241 €
ARAFURA RESOURCES	71 625	10 152 €
ARB CORP	14 173	121 652 €
ARC RESOURCES	9 808	182 606 €
ARCELORMITTAL	777 283	10 054 156 €
ARCH CAPITAL GROUP	62 635	2 091 317 €
ARCHER DANIELS	21 671	450 219 €
ARCS CO	31 800	492 342 €
ARDENT LEISURE GROUP	80 190	90 300 €
ARISTOCRAT LEISURE	114 181	283 227 €
ARKEMA	46 783	3 705 681 €
ARM HOLDINGS	174 787	1 654 992 €
ARRIUM	261 069	187 080 €
ARROW ELECTRON,ORD	6 538	188 840 €
ARTIS REAL	17 416	207 501 €
ARYZTA	67 508	2 630 092 €
ASAHI GLASS	150 000	823 684 €
ASAHI HOLDINGS	36 100	460 433 €
ASAHI KASEI	776 000	3 451 158 €
ASCENDAS INDIA TR	158 000	73 580 €
ASCENDAS REAL EST	891 402	1 311 781 €
ASCIANO UNIT	196 779	722 096 €
ASCOTT RESID,REIT	167 000	141 025 €
ASHFORD HOSPITALI,	11 879	94 697 €
ASHLAND	5 497	335 265 €
ASHMORE GROUP	144 008	638 102 €
ASHTREAD GROUP	956 161	5 025 415 €
ASIA STANDARD INTL	110 765	14 850 €
ASM PACIFIC TECHN,	41 000	378 355 €
ASML HOLDING	308 129	14 790 192 €
ASPEN GR	234 592	41 565 €
ASSA ABLOY S,B	111 203	3 149 334 €
ASSICURAZ,GEN,ORD,	1 055 734	14 505 785 €
ASSOCIATED BRITISH	625 676	12 064 570 €
ASSOCIATED ESTATES	7 492	91 604 €
ASSURANT	14 906	392 323 €
ASSYSTEM	88 800	1 322 232 €
ASTELLAS PHARMACEUTI	128 800	4 378 070 €
ASTRAZENECA	711 578	25 525 042 €
ASTRO JAPAN UNIT	13 967	32 226 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
ASX	34 853	856 573 €
AT AND T	297 100	7 596 512 €
ATLANTIA	471 016	6 438 789 €
ATLAS COPCO CAT,A	76 111	1 582 244 €
ATLAS COPCO S,B	20 285	374 159 €
ATLAS IRON	183 311	258 388 €
ATOS ORIGIN	60 012	3 172 234 €
AUCKLAND INTL ARPT	200 112	334 334 €
AURIZON HLDGS LTD	322 988	951 236 €
AURORA OIL & GAS	86 981	248 635 €
AUS,NZL BKG GROUP	547 140	10 792 863 €
AUSDRILL LTD	59 696	133 034 €
AUSENCO	18 268	45 889 €
AUSTIN	12 790	43 308 €
AUSTRAL,INFRASTR,	122 244	299 377 €
AUSTRALAND PROP,	57 825	154 819 €
AUSTRALIAN AGRIC	56 193	51 772 €
AUSTRALIAN PHARM,	83 049	30 737 €
AUSTRALIAN WLD,	104 205	99 700 €
AUSTRIAMICROSYSTEM	69 732	5 662 691 €
AUTODESK INC	8 598	230 536 €
AUTOGRILL	296 659	2 576 483 €
AUTOLIV	4 132	211 207 €
AUTOLIV SWED,DEPOS	24 240	1 222 344 €
AUTOM,DATA PROCES,	102 988	4 447 138 €
AUTOMOTIVE HOLDINGS	38 453	100 228 €
AUTONATION	5 881	177 090 €
AUTOZONE	13 273	3 568 226 €
AVAGO TECHNOLOGIES	8 755	210 181 €
AVALONBAY COMMUN,	28 325	2 913 066 €
AVERY DENNISON	5 785	153 225 €
AVEVA GROUP PLC	276 100	7 427 570 €
AVIVA	152 519	701 388 €
AVNET	114 231	2 652 162 €
AVON PRODUCTS	21 079	229 592 €
AXA	1 860 140	24 832 869 €
AXEL SPRINGER	227 905	7 357 913 €
AXFOOD	96 268	2 749 937 €
AXIS CAPITAL	8 430	221 492 €
AXIS COM	481 500	9 964 818 €
AZ ELECT,MATERIALS	793 407	3 416 805 €
BABCOCK & WILCOX	7 190	142 884 €
BABCOCK INTL GRP	470 743	5 603 531 €
BAE SYSTEMS	339 064	1 408 343 €
BAKER HUGHES ORD,	13 770	426 633 €
BALL	8 135	276 124 €
BALOISE HOLDING	34 972	2 274 861 €
BANCA GENERALI	50 040	646 016 €
BANCO BILBAO VIZC,	3 519 549	24 496 061 €
BANCO POP,ESPANOL	4 372 927	2 562 535 €
BANCO POPOLARE	1 429 730	1 798 600 €
BANCO SABADELL	2 555 086	5 046 295 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
BANK AMERICA	274 959	2 421 324 €
BANK IRELAND	20 700 000	2 359 800 €
BANK N,Y, MELLON	30 525	595 034 €
BANK NOVA SCOTIA	86 543	3 788 193 €
BANK OF EAST ASIA	421 040	1 221 666 €
BANK OF MONTREAL	19 016	881 629 €
BANK QUEENSLAND	61 757	357 441 €
BANKINTER	596 533	1 873 114 €
BARCLAYS	1 194 500	3 864 342 €
BARD (C,R,)	40 925	3 033 988 €
BARRICK GOLD	145 147	3 850 094 €
BARRY CALLEBAUT N,	20 410	14 882 996 €
BASF SE	628 568	44 722 613 €
BASWARE	27 362	554 081 €
BATHURST RESOURCES	142 712	41 019 €
BAWANG INTL	176 000	13 434 €
BAXTER INTL	152 016	7 686 125 €
BAYER	667 987	48 021 585 €
BB AND T	140 241	3 096 492 €
BCA CARIGE CASSA	1 248 492	961 963 €
BCA MONTE PASCHI	7 366 567	1 662 634 €
BCE	136 937	4 447 036 €
BCO ESP,CREDITO	63 902	227 172 €
BCO ESPIRITO SANTO	3 779 409	3 382 571 €
BCO SANT,CENT,HISP	6 695 841	40 844 630 €
BCP BCO NOM,	20 391 959	1 529 397 €
BE AEROSPACE	60 100	2 251 927 €
BEACH PETROLEUM	260 026	303 046 €
BEADELL RESOURCES	157 123	121 254 €
BEAM	5 967	276 490 €
BECHTLE	98 842	3 029 507 €
BECTON DICKINSON	55 892	3 314 772 €
BED BATH BEYOND	7 520	318 904 €
BEFIMMO SCA SICAFI	4 411	215 389 €
BEIERSDORF NOM,	258 055	15 968 443 €
BEKAERT NV PS	40 115	877 516 €
BELGACOM	812 153	18 033 857 €
BELIMO HOLDING	4 313	6 300 811 €
BELL ALIANT	39 904	800 086 €
BELLE INTL HOLD,	1 271 000	2 092 068 €
BEMIS CO	7 676	194 811 €
BEND,AND ADEL,BANK	81 383	544 732 €
BENI STABILI	163 403	72 894 €
BERKLEY	77 982	2 232 282 €
BERKSHIRE HATHAW,A	20	2 033 677 €
BERKSHIRE HATHAWAY B	321 670	21 885 466 €
BEST BUY	22 931	206 108 €
BESUNYEN HOLDINGS	132 000	6 200 €
BETSSON	145 400	3 399 018 €
BG GROUP	666 097	8 314 921 €
BGP HOLDINGS	3 056 274	- €
BHP BILLITON	824 429	23 558 766 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
BIC	151 673	13 699 105 €
BIG YELLOW	37 091	158 909 €
BILFINGER BERGER	71 049	5 186 577 €
BILLABONG INTL	91 650	59 902 €
BILLION IND HDGS	135 000	65 791 €
BIOGAIA B	73 000	1 489 483 €
BIOGEN IDEC	57 355	6 367 606 €
BIOMED REALTY TR, BIOMERIEUX	28 726	421 172 €
BIOSENSORS INTL GR	29 983	2 158 776 €
BIOSTIME INTERNATI	254 000	190 047 €
BK W AG	35 500	84 071 €
BLACKROCK	4 677	121 692 €
BLOCK (H,AND R,)	49 386	7 743 158 €
BLUESCOPE STEEL	51 222	721 475 €
BMC SOFTWARE	109 927	298 644 €
BMW	5 880	176 703 €
BNP PARIBAS	199 212	14 528 531 €
BOARDWALK REAL	778 578	33 155 744 €
BOART LONGYEAR	8 933	439 130 €
BOC HKG HOLD, BOEING	92 239	136 190 €
BOLIDEN	854 500	2 015 271 €
BOLLORE INVEST, BOMBARDIER CV CL,B	21 095	1 205 794 €
BORAL (NEW)	38 400	546 665 €
BORG WARNER	7 257	1 869 403 €
BOSHIWA INTL	103 675	296 959 €
BOSIDENG	155 481	535 044 €
BOSTON PROPERTIES	44 639	2 424 943 €
BOSTON SCIENTIFIC	122 000	20 057 €
BOUYGUES	468 000	105 336 €
BP	33 715	2 705 844 €
BQ CANTONALE VAUDOIS	48 287	209 864 €
BQUE,NAT,GRECE NOM	187 772	4 206 093 €
BRADKEN	2 298 855	12 039 867 €
BRAMBLES	12 820	5 149 565 €
BRAMMER	896 517	1 156 507 €
BRANDYWINE RLTY PB	32 810	141 585 €
BRE PROPERTIES INC	313 298	1 852 798 €
BRENNTAG	1 325 000	5 096 782 €
BRIDGESTONE	26 347	243 606 €
BRIGHTOIL PETRO HLD	15 788	608 695 €
BRISTOL MYERS ORD, BRIT,AMER,TOBACCO	81 126	8 066 358 €
BRITISH LAND	460 050	8 975 011 €
BRITISH SKY BROAD, BROADCOM CL,A	498 000	76 025 €
BROADRIDGE FINL	190 840	4 717 442 €
BROOKFIELD ASSET	606 032	23 319 269 €
BROOKFIELD PROP, BROWN AND BROWN	1 491 826	10 336 657 €
	1 298 071	12 274 941 €
	222 912	5 615 069 €
	23 002	399 185 €
	16 064	445 930 €
	87 576	1 131 476 €
	7 821	151 034 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
BROWN FORMAN CL,B	9 828	471 497 €
BRUNEL INTL	45 000	1 647 000 €
BT GROUP	1 852 744	5 278 870 €
BUNGE	8 248	454 754 €
BUNNINGS WAREHOUSE	234 725	399 249 €
BUNZL	230 397	2 866 115 €
BURBERRY GROUP	294 374	4 449 544 €
BURCKHARDT COMPRES	17 559	4 365 015 €
BUREAU VERITAS	80 990	6 855 804 €
BUZZI UNICEM ORD,	113 801	1 199 463 €
BYD ELECTRONIC INTL	181 000	35 602 €
C,P, POKPHAND	1 338 000	124 390 €
CA	20 612	343 638 €
CA IMMOBILIEN ANL,	21 367	223 712 €
CABCHARGE AUSTRAL,	23 853	82 271 €
CABLEVISION NY A	35 573	403 110 €
CABOT OIL GAS	7 029	265 187 €
CACHE LOGISTIC	151 000	116 262 €
CAFE DE CORAL HOLD	84 000	180 845 €
CAIRN ENERGY	216 520	706 873 €
CALLOWAY REAL ESTATE	19 972	440 458 €
CALPINE	37 941	521 746 €
CALTEX AUSTRALIA	26 992	408 313 €
CAMBRIDGE INDUST	227 520	95 359 €
CAMDEN PROPERTY PB	16 879	873 268 €
CAMECO	18 714	279 277 €
CAMERON INTL	155 773	6 670 922 €
CAMPBELL SOUP	127 025	3 361 576 €
CAMPUS CREST CMNTI	5 073	47 175 €
CAN,NAT,RAILWAY	11 126	765 606 €
CANADIAN APARTMENT	18 508	351 070 €
CANADIAN IMBK COMM	10 942	666 589 €
CANADIAN NATU,RES,	27 556	601 207 €
CANADIAN OIL SANDS	14 786	227 191 €
CANADIAN PACIFIC	8 035	617 606 €
CANADIAN REAL EST,	12 476	412 097 €
CANADIAN TIRE CL,A	5 899	311 779 €
CANADIAN UTILITIES	13 311	729 484 €
CANON	391 700	11 476 123 €
CANON ELECTRONICS	40 800	675 705 €
CAP GEMINI	111 006	3 647 657 €
CAP&COUNTRY PROPERTY	127 036	379 025 €
CAPE LAMBERT IRON	135 465	29 869 €
CAPITA GROUP	1 174 654	10 934 087 €
CAPITACOMM,REIT	825 148	863 318 €
CAPITAL ONE FCIAL	159 677	7 016 147 €
CAPITALAND	1 239 030	2 846 576 €
CAPITAMALL TRST FD	984 186	1 301 656 €
CAPITAMALLS ASIA	2 198 211	2 647 954 €
CAPITARETAIL	114 000	116 442 €
CAPLEASE	24 958	105 443 €
CARDINAL HEALTH	41 975	1 311 082 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
CARDNO LTD	27 460	150 718 €
CAREFUSION CORP	176 961	3 836 124 €
CARL ZEISS MEDITEC	150 000	3 262 500 €
CARLSBERG PREF,S,B	18 431	1 368 553 €
CARMAX	10 886	309 967 €
CARNARVON PETROLEUM	137 125	7 775 €
CARNIVAL	30 811	895 726 €
CARNIVAL PAIRED	6 513	181 647 €
CARREFOUR	478 771	9 261 825 €
CARSALES,COM,AU	46 004	265 902 €
CASINO GUICHARD	56 192	4 051 443 €
CASTELLUM	31 895	343 241 €
CATERPILLAR	44 613	3 032 239 €
CATHAY PAC,AIRWAYS	310 000	431 386 €
CBL ASSOCIAT,PROP,	27 671	445 162 €
CBRE GP A	11 140	168 148 €
CBS CL,B	483 918	13 966 232 €
CC LAND HOLDINGS	259 000	68 940 €
CDL HOSPITAL TRUSTS	324 995	379 379 €
CEDAR SHOPPING	11 137	44 602 €
CELANESE SER,A	67 834	2 291 147 €
CELESIO NOM,	123 413	1 609 923 €
CELGENE	36 828	2 191 970 €
Cenovus Energy	19 495	494 392 €
CENTERPOINT ENERGY	32 351	472 358 €
CENTRICA	4 574 556	18 814 843 €
CENTRO RETAIL AUST	572 658	1 023 650 €
CENTURYTEL	144 699	4 293 557 €
CERNER	9 616	565 334 €
CF INDUSTRIES	8 385	1 292 094 €
CFG LTD	61 800	20 913 €
CFS RETAIL PROP,	823 651	1 242 060 €
CH ROBINSON WORLD,	6 818	326 937 €
CHALLENGER FCIAL	110 843	308 988 €
CHAMPION REIT	1 180 066	428 435 €
CHAODA MODERN	670 000	72 123 €
CHARTER CIONS CL A	4 253	245 941 €
CHARTER HALL GROUP	48 196	124 105 €
CHARTER HALL REIT	121 653	360 198 €
CHARTWELL SENIORS	31 367	259 739 €
CHECK POINT SOFTW,	78 053	2 820 422 €
CHEN HSONG HOLD,	28 000	6 412 €
CHESAPEAKE ENERGY	27 790	350 326 €
CHESAPEAKE LODGING	5 636	89 259 €
CHEUNG KONG	99 000	460 186 €
CHEUNG KONG HOLD,	350 000	4 075 861 €
CHEVRONTEXACO	262 809	21 556 557 €
CHIBA BANK	173 000	764 842 €
CHIGO HOLDINGS LTD	606 000	11 564 €
CHIHO-TIANDE GROUP	146 000	55 864 €
CHIN,DONGXIANG GRP	568 000	57 252 €
CHINA AEROSPACE	466 000	31 466 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
CHINA AUTOMATION	154 000	32 703 €
CHINA DAYE NON-FERRO	1 230 000	37 916 €
CHINA GAS HOLDINGS	702 000	419 055 €
CHINA GREEN	135 000	20 477 €
CHINA HIGH PRECIS,	152 000	18 147 €
CHINA HIGH SPEED	267 000	78 908 €
CHINA HUIYUAN	118 500	32 702 €
CHINA ITS HLDGS	123 000	17 814 €
CHINA LIANSU GROUP	176 000	91 456 €
CHINA LILANG	70 000	31 442 €
CHINA LUMENA NEW M	568 000	93 382 €
CHINA MEDICAL SYSTEM	192 000	112 735 €
CHINA MENGNIU	267 000	574 829 €
CHINA METAL RECYCLIN	89 400	70 164 €
CHINA MILK PRODUCTS	239 000	45 295 €
CHINA MINING	1 654 000	18 290 €
CHINA NICKEL	232 000	14 076 €
CHINA OIL AND GAS	760 000	95 198 €
CHINA OIL RESOURCE	808 000	14 312 €
CHINA PRECIOUS MET	606 000	87 769 €
CHINA RARE EARTH	246 000	41 406 €
CHINA RESSOURCES	2 000 000	60 673 €
CHINA RONG HEAVY	706 000	85 670 €
CHINA SCE PROPERTY	279 000	52 149 €
CHINA SHANSHUI CEM	421 000	233 598 €
CHINA SHINWAY PHA	49 000	62 816 €
CHINA SINGYES SOLAR	86 400	55 804 €
CHINA SOUTH CITY	362 000	41 448 €
CHINA TONTINE WINE	296 000	22 304 €
CHINA TRAVEL INTL	570 000	88 690 €
CHINA VANADIUM TIT	203 000	36 354 €
CHINA WATER AFF,	220 000	51 455 €
CHINA WINDPOWER GROU	740 000	20 639 €
CHINA WIRELESS	316 000	69 269 €
CHINA XLX FERTILISER	59 000	11 540 €
CHINA YURUN FOOD	262 000	144 349 €
CHINA ZHENGTONG	172 500	90 988 €
CHINA ZHONGWANG HOL	324 800	91 858 €
CHINASOFT INTL	240 000	42 041 €
CHIPOTLE MEXICAN A	1 981	446 957 €
CHIYODA	125 000	1 477 719 €
CHOCOL,LINDT SPRUN	469	13 413 602 €
CHOCOLAD,LINDT BP	1 024	2 528 605 €
CHORUS	77 465	142 511 €
CHOW SANG INTL	41 000	72 140 €
CHOW TAI FOOK JEWL	221 400	269 527 €
CHR, HANSEN HOLD,	618 122	15 219 007 €
CHRISTIAN DIOR	49 449	6 341 834 €
CHUBB	36 757	2 099 922 €
CHUO MITSUI TRUST	1 221 480	3 225 136 €
CHURCH AND DWIGHT	31 323	1 272 734 €
CI FINANCIAL	14 824	281 528 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
CIGNA	171 717	6 962 978 €
CIMAREX ENERGY	3 216	140 822 €
CIMENTS FRANCAIS	6 555	293 074 €
CINCINNATI FCIAL	7 853	233 255 €
CINEWORLD GROUP	408 743	1 316 534 €
CINTAS	13 359	414 429 €
CINTRA CONCESIONES	436 719	4 891 253 €
CISCO SYSTEMS	1 044 507	15 567 306 €
CIT GROUP	6 673	195 574 €
CITIC 21 CN CO	546 000	24 044 €
CITIC TELECOM INTL	187 000	38 430 €
CITIGROUP	910 988	27 335 168 €
CITIZEN HOLDINGS	119 300	473 014 €
CITRIX SYSTEMS	9 715	483 539 €
CITY DEVELOPMENTS	266 475	2 129 484 €
CITY NATIONAL	5 914	222 134 €
CITY TELECOM (H,K,	68 000	17 967 €
CITYCON	35 351	90 852 €
CITYSPRING INFRA	225 000	61 472 €
CLARIANT NOM,	38 519	394 191 €
CLARION	254 000	331 982 €
CLIFFS NATURAL	6 659	194 810 €
CLOROX	32 409	1 799 899 €
CLOUGH LTD	55 584	40 706 €
CLP HOLDINGS	367 000	2 329 058 €
CME GROUP	17 068	655 974 €
CNA FINANCIAL	4 587	97 453 €
CNA HONGXING SPRT	449 000	28 867 €
CNH GLOBAL	4 316	131 896 €
CNP ASSURANCES	150 351	1 744 823 €
COACH	8 829	371 737 €
COAL OF AFRICCA LTD	139 617	25 837 €
COALSPUR MINES LTD	83 386	47 278 €
COBHAM	679 177	1 848 875 €
COCA COLA HBC	187 973	3 327 122 €
COCA-COLA	392 339	10 787 537 €
COCA-COLA AMATIL	114 644	1 214 239 €
COCA-COLA ENTREPRISE	311 692	7 501 507 €
COCHLEAR	11 348	706 848 €
COCKATOO COAL NPV	149 014	13 494 €
COFFEY INTL	52 850	13 734 €
COFINIMMO	2 811	251 866 €
COGNIZANT TECHN,A	43 147	2 417 931 €
COLGATE PALMOLIVE	43 977	3 487 072 €
COLONIA REAL EST,	6 936	31 940 €
COLONIAL PROP,PB	16 156	261 873 €
COLOPLAST B NV	559 975	20 752 324 €
COLRUYT	297 519	11 156 963 €
COMBA TELECOM	87 353	23 850 €
COMCAST CL,A	786 585	22 289 757 €
COMCAST CL,A SPL	57 195	1 558 286 €
COMERICA	10 718	246 651 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
COMFORTDELGRO	418 000	461 993 €
COMINAR REAL ESTATE	23 392	402 192 €
COMM,BANCSHARES	4 967	132 087 €
COMMERZBANK	3 019 944	4 330 600 €
COMMONWEALTH REIT	15 406	185 096 €
COMPASS GROUP	1 368 497	12 232 281 €
COMPUGROUP MEDICAL	24 142	353 560 €
COMPUTER SCIENCES	6 784	206 083 €
COMPUTERSHARE	111 841	791 756 €
COMW,BK AUSTRALIA	324 195	15 874 041 €
COMW,PROP,UNIT	912 449	732 891 €
CONAGRA FOODS	66 067	1 478 289 €
CONCHO RESOURCES	3 483	212 827 €
CONOCOPHILLIPS	36 193	1 591 954 €
CONSOL ENERGY INC,	25 199	613 538 €
CONSOL,EDISON	98 148	4 134 663 €
CONST,AUX,FERROC,	19 727	6 884 723 €
CONSTELLATION CL,A	166 911	4 480 416 €
CONTACT ENERGY	77 159	251 065 €
CONTINENTAL	108 073	9 466 114 €
CONTINENTAL RES,	8 505	474 084 €
CONWERT IMMO,INV,	19 795	193 397 €
COOPER NV	32 962	2 312 140 €
CORIO	67 554	2 318 116 €
CORNING	44 715	428 021 €
CORP,FINANC,ALBA	36 176	1 277 375 €
CORPORATE OFF,PB	13 231	250 691 €
COSCO	179 000	99 475 €
COSTCO WHOLESALE	128 482	9 621 532 €
COUNTRY GARDEN	1 567 593	622 822 €
COUSINS PROPERTIES	18 507	117 213 €
COVENTRY HEALTH	18 883	642 085 €
COVIDIEN	307 881	13 483 805 €
CREDIT AGRICOLE	711 119	4 326 448 €
CREDIT SAISON	199 900	3 759 523 €
CREDIT SUISSE GRP	14 278	263 365 €
CREE	15 076	388 564 €
CRESCENT POINT ENE	11 150	319 542 €
CRH	34 204	523 321 €
CRITERIA CAIXACORP	1 033 624	2 725 666 €
CRODA INTL	634 414	18 584 239 €
CROMBIE REIT	8 100	91 076 €
CROWN	110 034	924 532 €
CROWN CASTLE INTL	30 620	1 675 925 €
CSE GLOBAL	103 000	49 885 €
CSL	103 132	4 377 364 €
CSR	100 927	155 774 €
CST MINING GROUP	3 920 000	41 430 €
CSX	29 028	434 407 €
CTS EVENTIM	209 456	5 580 955 €
CUDECO LTD	38 562	130 575 €
CUMMINS	26 321	2 163 137 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
CVS CAREMARK	250 296	9 179 165 €
CYBERAGENT	842	1 307 316 €
D R HORTON	40 543	608 268 €
DAEJAN HOLDINGS	1 782	67 668 €
DAH SING BANKING	74 400	61 377 €
DAH SING FINANCIAL	29 900	102 264 €
DAI-ICHI MUTUAL LIFE	2 275	2 392 741 €
DAILY MAIL GEN,A	161 636	1 098 033 €
DAIMLERCHRYSLER	773 106	31 944 740 €
DAINIPPON SCREEN	265 000	1 215 746 €
DAITO TRUST CONST,	22 700	1 622 851 €
DAIWA HOUSE IND,	235 000	3 048 816 €
DAIWA SECU,GRP	299 000	1 245 833 €
DAIWAHOUSE RESIDEN	28	166 035 €
DANAHER	265 161	11 242 794 €
DANSKE BANK	70 621	905 361 €
DAPHNE INTER	166 000	172 519 €
DARDEN RESTAURANTS	14 707	502 764 €
DART ENERGY	154 855	19 511 €
DASSAULT SYSTEMES	83 836	7 061 506 €
DAVID JONES	111 806	207 782 €
DAVIDE CAMPARI	276 752	1 605 162 €
DAVITA	13 734	1 151 410 €
DBS GROUP HOLDINGS	361 500	3 331 052 €
DCT INDUSTRIAL	45 131	222 163 €
DE LONGHI	334 221	3 649 693 €
DE MASTER BLENDERS	413 130	3 602 080 €
DEEP YELLOW	153 921	7 394 €
DEERE	10 689	700 655 €
DELHAIZE GROUP PS	116 486	3 523 702 €
DELL	76 843	591 010 €
DELPHI AUTOMOTIVE	195 130	5 661 197 €
DELTA AIR LINES	38 949	350 671 €
DELTICOM	106 632	3 444 214 €
DENA	83 600	2 084 133 €
DENBURY RESOURCES	30 078	369 587 €
DENSO	190 500	4 968 039 €
DENTSPLY INTL	6 394	192 101 €
DERWENT LONDON	328 360	8 525 782 €
DEU,LUFTHANSA NOM,	174 798	2 489 124 €
DEUTSCHE BANK NOM,	610 086	20 102 334 €
DEUTSCHE BORSE	154 211	7 126 090 €
DEUTSCHE EUROSHOP	41 475	1 312 269 €
DEUTSCHE POST NOM,	644 853	10 704 560 €
DEUTSCHE TELEKOM	3 346 021	28 759 051 €
DEUTSCHE WOHN,POR,	176 964	2 477 496 €
DEVELOPERS DIVERS RE	60 508	718 716 €
DEVELOPMENT SECU,	40 771	71 881 €
DEVON ENERGY	14 746	582 055 €
DEVRO	1 475 000	5 617 402 €
DEXIA	428 399	29 988 €
DEXUS PTY,UNIT	1 883 918	1 505 770 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
DIA	484 735	2 331 575 €
DIAGEO	935 028	20 600 358 €
DIALIGHT	151 000	1 978 955 €
DIALOG SEMICOND,	166 177	2 218 629 €
DIAMOND OFFSHORE	6 843	352 738 €
DIAMONDROCK	30 841	210 535 €
DIASORIN	67 882	2 055 467 €
DIC ASSET	12 653	92 443 €
DICKSON PROV,REGPT	53 000	21 317 €
DIGITAL CHINA	170 000	219 930 €
DIGITAL REALTY TRUST	41 627	2 143 551 €
DIGNITY	756 019	10 159 792 €
DIRECT TV NV	41 582	1 582 034 €
DISCO	14 800	580 965 €
DISCOVER FINANCIAL	281 391	8 227 869 €
DISCOVERY COM CL A	144 209	6 943 558 €
DISCOVERY COM CL C	22 347	991 580 €
DISCOVERY METALS	85 377	109 587 €
DISH NETWORK CORP	20 093	554 752 €
DISNEY WALT-DISNEY	273 466	10 327 573 €
DKSH HOLDING	28 475	1 554 941 €
DNB NOR	34 664	332 599 €
DOLLAR GENERAL	34 303	1 147 163 €
DOLLAR TREE	61 000	1 876 638 €
DOMINION RESOURCES	72 955	2 866 406 €
DOMINO PRINTING	2 320 490	16 679 148 €
DOMINO'S PIZZA UK	1 590 000	9 750 536 €
DONGYUE GROUP	205 000	102 914 €
DONNELLEY AND SONS	18 544	126 449 €
DOUGLAS EMMETT	22 571	398 896 €
DOUTOR-NICHIRE	3 500	34 570 €
DOVER	105 625	5 264 426 €
DOW CHEMICAL	30 293	742 836 €
DOWNER EDI	85 271	271 949 €
DR PEPPER SNAPPLE	22 753	762 460 €
DRAEGERWERK	78 454	4 471 878 €
DRAGERWERK PREF,	16 595	1 269 849 €
DRAGON OIL REGPT	151 934	1 039 617 €
DRAX GROUP	303 818	2 039 562 €
DRILLSEARCH ENERGY	90 593	108 435 €
DST SYSTEMS	3 953	181 699 €
DSV	353 744	6 907 988 €
DTE ENERGY	12 734	580 004 €
DU PONT DE NEMOURS	51 508	1 757 246 €
DUET	226 182	370 469 €
DUFY GROUP-REG	47 777	4 734 943 €
DUKE ENERGY	118 051	5 712 723 €
DUKE REALTY	110 347	1 160 887 €
DULUX GROUP	71 864	213 911 €
DUN BRADSTREET	8 110	483 807 €
DUNDEE INTL REAL E	13 587	113 130 €
DUNDEE REAL ESTATE	18 503	527 590 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
DUNELM GROUP	1 331 942	11 453 946 €
DUPONT FABRS TCHNL	11 524	211 180 €
E,ON	1 396 407	19 675 375 €
EAST JAPAN RAILWAY	36 600	1 791 474 €
EASTGROUP PROPERTIES	5 119	208 930 €
EASTMAN CHEMICAL	122 737	6 335 143 €
EATON CORP	14 643	601 758 €
EBAY	190 553	7 370 877 €
ECHO ENTERTAINMENT	165 332	447 864 €
ECOLAB	29 297	1 597 735 €
EDENRED	414 547	9 658 945 €
EDF	199 784	2 792 980 €
EDISON INTL	136 819	4 689 662 €
EDP ENERG,PORTUGAL	4 212 346	9 646 272 €
EDP RENOVAVEIS	352 366	1 407 350 €
EDUCATION REALTY	16 689	134 687 €
EDWARDS LIFESCIEIN,	9 409	643 515 €
EFG EUROBK ERGAS,	322 761	206 890 €
EIFPAGE	63 945	2 146 634 €
ELAN	529 026	4 141 216 €
ELDERS	90 386	8 185 €
ELDORADO GOLD	95 703	933 190 €
ELECTRIC POWER	42 800	768 898 €
ELECTROLUX B	62 589	1 244 220 €
ELECTRONIC ARTS A	45 811	504 533 €
ELEKTA S,B	2 538 570	30 012 475 €
ELEMENTIS	629 240	1 803 702 €
ELI LILLY ORD	152 584	5 708 012 €
ELISA CORP,S,A	569 701	9 531 098 €
ELRINGKLINGER	109 236	2 785 518 €
EMC	467 109	8 963 788 €
EMECO HOLDINGS	126 238	60 639 €
EMERSON ELECTRIC	69 784	2 803 217 €
EMPEROR WATCH & JE	580 000	53 921 €
EMS CHEMIE HOL,NOM	7 369	1 315 282 €
ENAGAS	205 916	3 323 484 €
ENBRIDGE	105 256	3 449 465 €
ENCANA	22 642	339 104 €
ENDESA	73 897	1 246 642 €
ENEL ENERG,ELET,	4 663 265	14 633 326 €
ENEL GREEN POWER	1 623 742	2 281 358 €
ENERG,RES,A AUD0,2	41 498	41 501 €
ENERGIZER HOLDINGS	11 236	681 626 €
ENGILITY HOLDINGS	7 502	109 594 €
ENI	2 134 296	39 142 989 €
ENN ENERGY	164 000	541 654 €
ENQUEST PLC	5 500 000	8 208 190 €
ENERGY	6 040	292 059 €
ENVESTRA UNIT	235 050	173 988 €
EOG RESOURCES	199 085	18 239 895 €
EPR PROPERTIES	8 624	301 618 €
EPURE SOUND GLOBAL	134 000	48 258 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
EQUATORIAL RESOURC	23 195	24 110 €
EQUIFAX	117 147	4 808 856 €
EQUITABLE CORP	5 975	267 298 €
EQUITY LIFESTYLE	8 676	442 816 €
EQUITY ONE	10 461	166 706 €
EQUITY RESIDENTIAL	91 017	3 912 267 €
ERAMET	11 923	1 322 857 €
ERIE INDEMNITY C,A	6 278	329 614 €
ERSTE BANK OSTERR,	217 766	5 231 828 €
ESPRIT HOLDINGS	392 704	412 738 €
ESSAR ENERGY	173 639	255 824 €
ESSEX PROPERTY TRUST	7 391	822 125 €
ESSILOR INTL	392 057	29 804 173 €
ESUN HOLDINGS	190 000	27 704 €
EULER HERMES	17 819	1 158 235 €
EUR,AERO,DEFENCE	362 323	10 688 529 €
EURASIAN NATURAL	85 968	301 010 €
EURAZEO	33 646	1 218 153 €
EUROBK PROPERTIES	6 528	31 987 €
EUROCOMM, PROPRTS	7 483	225 538 €
EUROFINS SCIENT,	24 149	2 958 253 €
EUROMONEY INST INV	104 599	1 122 592 €
EUTELSAT COMM,PROM	283 929	7 126 618 €
EVA PRECISION IND	240 000	29 593 €
EVEREST REINS,GRP	21 352	1 780 683 €
EVERGRANDE	1 226 000	509 899 €
EVOLUTION MINING	105 484	142 041 €
EVS BROADCAST EQ,	82 645	3 669 438 €
EWC LTD	243 148	69 887 €
EXCEL TRUST	6 976	67 040 €
EXELIS INC	23 723	202 790 €
EXELON	22 308	503 216 €
EXOR ORD,	62 958	1 196 202 €
EXPEDIA	18 875	879 612 €
EXPEDITORS INTL	12 139	364 152 €
EXPERIAN	516 302	6 238 145 €
EXPRESS SCRIPTS	229 366	9 394 542 €
EXTENDICARE	23 178	135 074 €
EXTRA SPACE STORAGE	21 580	595 643 €
EXXON MOBIL	450 027	29 543 262 €
EZION HOLDINGS	134 000	140 615 €
EZRA HOLDINGS	149 400	105 753 €
F&C COMMERCIAL	135 940	173 801 €
F5 NETWORKS	74 712	5 505 363 €
FACEBOOK CL A	24 348	491 608 €
FAIRFAX FCIAL VTG	2 116	577 963 €
FAIRFAX MEDIA	141 299	56 747 €
FAIVELEY	25 400	1 244 600 €
FAMILY DOLLAR STO,	31 160	1 498 677 €
FAMILY MART	18 600	580 026 €
FANTASIA HOLDINGS	381 000	47 724 €
FANUC	14 100	1 969 053 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
FAR EAST CONSORT,	166 000	33 951 €
FASTENAL	10 869	384 587 €
FASTIGHETS AB BALD	19 546	85 004 €
FAURECIA	51 512	603 721 €
FDAL REALTY INV,	39 819	3 141 666 €
FEDEX	37 743	2 625 749 €
FELCOR LODGING TRUST	21 627	76 607 €
FENNER PLC	1 681 703	8 216 729 €
FERREXPO	97 427	301 734 €
FIAT INDUSTRIAL	627 503	5 180 037 €
FIAT ORD,	647 992	2 455 890 €
FIDELITY NATIONAL	66 765	1 762 811 €
FIELMANN	12 578	918 194 €
FIFTH THIRD BCP	407 156	4 694 153 €
FINMECCANICA	455 334	1 981 614 €
FINNING INTL	10 764	201 471 €
FIRST CAPITAL	13 185	189 032 €
FIRST IND,REALTY	15 730	167 990 €
FIRST PACIFIC	596 000	496 341 €
FIRST POTOMAC REALIT	8 785	82 359 €
FIRST REIT	92 000	60 553 €
FIRST REPUBLIC BK	25 901	643 989 €
FIRST RESOURCES LTD	92 000	115 393 €
FIRST SHIP LEASE	94 000	7 413 €
FIRST SOLAR	4 401	103 000 €
FIRSTENERGY	26 927	852 906 €
FISERV	45 780	2 744 230 €
FISHER PAYKEL HEA,	111 392	172 166 €
FISHER PLC	450 000	4 493 897 €
FKP PROPERTY	46 215	41 124 €
FLD IND,B DIVISION	13 006	570 374 €
FLEETWOOD CORP	12 265	94 554 €
FLETCHER BUILDING	136 811	718 256 €
FLEXIGROUP LIMITED	46 037	134 859 €
FLEXTRONICS INTL	36 233	170 667 €
FLIGHT CENTRE	14 829	315 287 €
FLINDERS MINES	355 747	19 610 €
FLOWSERVE	62 408	6 948 949 €
FLUOR	67 517	3 008 153 €
FMC TECHNOLOGIES	7 895	256 480 €
FOMENTO CONSTR,	67 800	635 286 €
FONC,DES REGIONS	39 073	2 473 321 €
FOOK WOO GROUP HOL	360 000	48 264 €
FOOT LOCKER	22 261	542 342 €
FORD MOTOR	120 588	1 184 477 €
FOREST CITY ENT,A	27 885	341 583 €
FOREST LAB,CL,A	61 303	1 642 310 €
FORTESCUE METALS	468 841	1 716 758 €
FORTIS	13 020	339 411 €
FORTUM	860 219	12 172 099 €
FORTUNE BRANDS	9 806	217 333 €
FORTUNE REAL EST,	249 000	155 218 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
FOSSIL	2 696	190 380 €
FOSTER WHEELER AG	7 135	131 617 €
FOSUN INTL	386 000	186 981 €
FOXCONN INTL HOLD, FP	428 000	157 484 €
FRANCE TELECOM	27 400	1 386 825 €
FRANCO NEVADA	1 528 540	12 746 495 €
FRANKLIN RESOURCES	65 485	2 832 512 €
FRANKLIN STREET	4 437	423 036 €
FRAPORT AG	14 907	139 188 €
FRASER & NEAVE	46 810	2 056 597 €
FRASERS CENTREPOINT	281 000	1 692 456 €
FRASERS COMM TRUST	120 000	149 022 €
FREEPORT MCMORAN	123 600	101 305 €
FREIGHTWAYS	23 683	614 350 €
FRESENIUS	30 384	80 803 €
FRESENIUS MED,CARE	224 894	19 588 267 €
FRESNILLO PLC	469 305	24 549 345 €
FRIGOGLASS NOM, FRONTIER COMM, B	368 917	8 400 810 €
FRONTIER REIT	391 542	2 063 426 €
FST QUANTUM MINE, FU JI FOOD CATER, FUCHS PETROLUB PF	143 984	467 424 €
FUFENG GROUP	41	271 535 €
FUGRO	130 848	2 183 956 €
FUJI HEAVY IND, FUJI OIL	72 000	53 549 €
FUJI TV NETWORK	296 881	16 681 743 €
FUJITSU	168 000	56 226 €
FUJITSU GENERAL	139 443	6 208 002 €
FURUKAWA ELECTRIC	435 000	4 105 789 €
FUSHAN ENERGY	27 900	305 676 €
G RESSOURCES GROUP	484	552 354 €
G,U,D,HOLDINGS	1 530 000	4 831 579 €
G4S	199 000	1 419 184 €
GAGFAH	470 000	791 579 €
GALAXY	538 000	150 048 €
GALAXY RESOURCES L	3 954 000	141 232 €
GALENICA NOM, GALLAGHER	14 535	99 006 €
GALLANT VENTURE LTD	16 174	143 318 €
GALLIFORD TRY	420 000	1 247 419 €
GALP ENERGIA CL,B	80 336	24 988 €
GAM HOLDING	4 982	2 190 049 €
GAMELOFT	21 463	564 087 €
GAMESTOP CL,A	189 000	33 446 €
GANNETT	807 193	7 404 162 €
GAP	281 722	3 313 051 €
GARMIN	28 461	291 261 €
GAS NATURAL SDG	363 900	1 928 670 €
GATEGROUP HOLDING	24 260	461 683 €
	169 628	2 317 203 €
	187 748	4 420 281 €
	25 705	794 508 €
	289 488	3 931 247 €
	240 292	4 778 760 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
GCL POLY ENERGY HOLD	1 555 000	237 388 €
GDF SUEZ	1 165 009	18 145 015 €
GEA GROUP	506 283	12 388 745 €
GEBERIT NOM,	2 028	338 448 €
GECINA NOM,	25 416	2 157 818 €
GEELY AUTOMOBILE	835 000	299 886 €
GEMALTO	110 709	7 528 212 €
GEN,PROPERTY TRUST	704 540	2 041 662 €
GENERAL ELECTRIC	1 209 402	19 254 663 €
GENERAL GROWTH PRO	106 207	1 599 066 €
GENERAL MILLS	167 656	5 140 060 €
GENERAL MOTORS	18 104	395 888 €
GENTEX	8 585	122 745 €
GENTING SINGAPORE	1 238 000	1 064 657 €
GENUINE PARTS	21 187	1 021 746 €
GENUS PLC	419 000	7 216 656 €
GENWORTH FCIAL C,A	31 233	177 912 €
GEOPHYSIQUE(GLE)	153 549	3 468 672 €
GEORGE WESTON	7 506	404 147 €
GERRESHEIMER	124 539	4 993 391 €
GERRY WEBER INTL	61 561	2 247 592 €
GESTEVISION TELEC,	154 617	787 001 €
GETINGE B	49 036	1 257 802 €
GETTY REALTY CORP	4 240	58 081 €
GFK	155 000	5 981 450 €
GILEAD SCIENCES	179 030	9 974 024 €
GINDALBIE METALS	186 780	36 771 €
GIORDANO INTL	300 000	218 717 €
GIVAUDAN NOM,	24 954	19 912 746 €
GJENSIDIGE FORSIKR	837 510	9 063 170 €
GKN (NEW)	153 558	433 166 €
GLANBIA	127 856	1 067 598 €
GLAXOSMITHKLINE	1 431 704	23 564 602 €
GLENCORE INTL,	116 735	505 597 €
GLIMCHER REALITY	25 541	214 844 €
GLOBAL BIO CHEM	489 600	42 163 €
GLOBAL LOGISTIC PR	895 027	1 544 971 €
GLORIOUS PROPERTY	609 000	87 011 €
GMG GLOBAL	1 126 000	92 989 €
GOLDCORP	143 444	3 996 151 €
GOLDEN AGRI-RESOURCE	1 963 132	792 323 €
GOLDEN EAGLE	116 000	216 591 €
GOLDEN MEDITECH	344 000	26 594 €
GOLDMAN SACHS	76 932	7 443 451 €
GOME ELEC,APPL,	2 492 760	224 426 €
GOODMAN FIELDER	390 662	190 732 €
GOODMAN GRP UNIT	640 729	2 184 705 €
GOODMAN PROPETY T,	156 855	99 132 €
GOODPACK	73 000	83 403 €
GOODTOP TIN	420 000	18 084 €
GOOGLE CL,A	42 410	22 754 844 €
GOVERNMENT PRO,SBI	6 307	114 668 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
GPE BRUXEL,LAMBERT	322 504	19 395 391 €
GPE EUROTUN,REGPT	444 610	2 596 522 €
GRAINCORP	43 290	421 003 €
GRAINGER	52 906	77 360 €
GRAINGER (W,W,)	2 431	373 150 €
GRANITE REAL ESTAT	10 501	302 063 €
GREAT EAGLE HOLD,	62 000	155 930 €
GREAT PORTL,ESTAT,	57 902	349 154 €
GREAT-WEST LIFECO	13 659	253 368 €
GREE INC	83 000	974 158 €
GREEK ORG,FOOTBALL	376 853	2 035 006 €
GREEN MTN COFFEE	6 678	209 397 €
GREENTOWN CHINA HLD	175 500	243 876 €
GRENKELEASING	33 545	1 697 712 €
GRIFOLS	263 209	6 938 189 €
GRIFOLS DA12	164 040	147 308 €
GROUPE CGI CL,A	29 464	514 896 €
GROUPE DANONE	524 106	26 155 510 €
GRYPHON MINERALS	63 528	25 763 €
GSW IMMOBILIEN	108 816	3 482 112 €
GUNNS LIMITED	161 123	20 301 €
GUOCOLAND	47 333	70 537 €
GUOCOLEISURE	134 000	54 499 €
GWA GROUP LTD	60 241	109 106 €
GZI REIT	395 000	142 249 €
H2O RETAILING	155 000	1 093 158 €
HAIER ELECTRONICS GP	145 000	160 911 €
HAITIAN INTL HLD	128 000	115 866 €
HALLIBURTON	373 521	9 828 158 €
HALMA	2 164 283	12 258 311 €
HAMBORNER	11 329	84 786 €
HAMBURGER HAFEN LO	31 947	569 296 €
HAMMERSON	629 423	3 789 265 €
HANG LUNG GROUP	201 000	866 456 €
HANG LUNG PROPERT,	866 732	2 612 401 €
HANG SENG BANK	154 000	1 788 858 €
HANNOVER RUCK,NOM,	163 313	9 628 934 €
HANSTEEN HOLDINGS	138 817	136 917 €
HARGREAVES LANSDOWN	821 847	6 900 232 €
HARLEY-DAVIDSON	145 664	5 395 004 €
HARMAN INTL IND,	9 224	312 317 €
HARRIS	118 802	4 411 822 €
HARTFORD FINANCIAL	14 646	249 284 €
HARVEY NORMAN	155 955	233 337 €
HASBRO	5 826	158 642 €
HASTIE	21 384	2 694 €
HAYS	612 041	621 021 €
HCA HOLDINGS	9 092	208 059 €
HCP	104 275	3 571 798 €
HEALTH CARE REIT	106 425	4 947 503 €
HEALTH CARE RLTY T	14 385	261 972 €
HEIDELBERGCEMENT	131 098	6 008 221 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
HEINEKEN	270 260	13 640 022 €
HEINEKEN HOLDING	95 063	3 938 935 €
HEINZ	66 609	2 914 144 €
HELICAL BAR	19 355	54 944 €
HELLENIC PETROLEUM	120 034	888 252 €
HELLENIC TELECOM,	432 005	2 203 226 €
HENDERSON INVEST,	197 000	11 567 €
HENDERSON LAND	480 464	2 571 891 €
HENG TAI	1 055 250	22 202 €
HENGAN INTL GROUP CO	184 500	1 262 957 €
HENGDELI HLDGS	240 000	65 292 €
HENKEL PF	169 387	10 535 871 €
HENKEL POR	109 889	5 706 536 €
HENNES MAURITZ S,B	247 458	6 477 278 €
HERBALIFE	4 478	111 882 €
HERMES INTL	25 068	5 672 888 €
HERSHA CL,A SBI	36 034	136 658 €
HERSHEY FOODS	36 816	2 016 726 €
HESS	11 890	477 620 €
HEWLETT PACKARD	493 110	5 329 807 €
HEXAGON B	160 563	3 053 333 €
HI SUN TECH CHINA	399 000	34 361 €
HIDILI INDUSTRY	207 000	41 324 €
HIGHWOODS PROP,	15 756	399 756 €
HIKMA PHARMACEUT,	360 500	3 382 326 €
HILLS INDUSTRIES	49 347	35 167 €
HILLSHIRE BRANDS	42 999	917 773 €
HI-P INTERNATIONAL	68 000	32 512 €
HITACHI	974 000	4 306 105 €
HITACHI CHEMICAL	174 000	1 972 000 €
HITACHI HIGH-TECH,	35 700	555 855 €
HITACHI KOKI	8 000	49 333 €
HITACHI TRANSPORT	92 200	1 018 244 €
HKC HOLDINGS	819 870	23 669 €
HKG AND CHINA GAS	1 310 633	2 712 663 €
HKG EXCHANGES	231 200	2 984 262 €
HKG LAND HOLD,	695 511	3 687 517 €
HKR INTERNATIONAL	136 000	52 703 €
HO BEE INVESTMENT	61 000	72 533 €
HOCHTIEF	49 408	2 170 493 €
HOGANAS S,B	41 385	1 199 069 €
HOLCIM NOM,	55 372	3 069 595 €
HOLLYFRONTIER	8 853	312 581 €
HOLMEN S,B	19 249	431 805 €
HOME DEPOT	260 383	12 215 328 €
HOME PROPERTIES	9 019	419 414 €
HONDA MOTOR	508 100	14 017 320 €
HONEYWELL INTL	74 437	3 583 523 €
HONG KONG CHINESE	138 000	17 286 €
HONG LEONG ASIA	24 000	25 036 €
HONGKONG ELECTRIC	323 500	2 095 736 €
HOPEWELL HOLDINGS	132 000	429 507 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
HOPEWELLE HIGHWAY	178 600	75 329 €
HOPSON DEVELOPMENT	142 000	172 034 €
HORIZON OIL LTD	226 356	76 646 €
HORMEL FOODS	105 214	2 490 692 €
HOSPIRA	3 634	86 109 €
HOSPITALIT,PROP,PB	43 273	768 700 €
HOST HOTELS	195 606	2 324 898 €
HR REAL ESTATE	36 897	677 396 €
HSBC HOLDINGS	3 596 955	28 687 834 €
HUABAO INTERNATIONAL	464 000	174 363 €
HUBER SUHNER	29 590	1 066 593 €
HUDSON CITY	101 183	623 952 €
HUDSON PACIFIC PRO	8 323	132 951 €
HUFVUDSTADEN LIB,A	715 478	6 836 282 €
HUGO BOSS	72 105	5 753 979 €
HUHTAMAKI	348 356	4 274 328 €
HUMANA	85 877	4 470 372 €
HUNT TRANSPORT SCE	4 784	216 666 €
HUNTING	481 068	4 688 500 €
HUNTINGTON BANCSH,	47 604	230 726 €
HUSKY ENERGY	9 371	209 878 €
HUSQVARNA AB CL,B	224 383	1 025 274 €
HUTCH,HARBOUR RING	722 000	47 339 €
HUTCH,WHAMPOA ORD	644 000	5 098 457 €
HUTCHINSON TELEC	291 000	101 379 €
HUTCHISON PORT HOL	894 000	535 695 €
HYFLUX	129 000	102 527 €
HYSAN DEVELOPMENT	309 978	1 129 956 €
I,T LIMITED	94 000	29 712 €
IAC INTERACTIVE CORP	77 068	2 761 564 €
IAMGOLD	44 747	388 260 €
IBERDROLA	3 012 521	12 637 526 €
IBM	155 926	22 654 449 €
ICADE	36 545	2 445 591 €
ICAP	164 326	621 971 €
IFI PRIV,	51 597	855 478 €
IG GROUP HOLDINGS	404 671	2 245 123 €
IGM FINANCIAL	10 181	322 640 €
IHI	935 000	1 820 789 €
IINET	36 789	132 683 €
ILIAD	82 499	10 728 995 €
ILLINOIS TOOL WRK	13 996	645 553 €
ILLUMINA	13 547	571 206 €
ILUKA RESOURCES	84 314	598 876 €
IMDEX	38 530	51 125 €
IMERYS	30 756	1 482 132 €
IMI	426 758	5 771 835 €
IMMOAEST NV	1 227 354	- €
IMMOBILIARE GRANDE	45 084	36 969 €
IMMOFINANZ	1 006 169	3 195 593 €
IMMOFINANZ DA10	720 883	- €
IMPERIAL TOBACCO	503 251	14 723 396 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
IMTECH	277 538	4 826 386 €
INBEV	735 950	48 381 353 €
INCHCAPE	541 907	2 878 902 €
INCITEC PIVOT	327 151	832 111 €
IND&INFRA FD INVST	31	175 667 €
INDEPENDENCE GROUP	48 454	177 424 €
INDITEX	256 209	27 030 050 €
INDOFOOD AGRI RES,	93 000	77 091 €
INDOPHIL RESOURCES	179 342	33 894 €
INDRA SISTEMAS	227 740	2 281 955 €
INDUSTRIVARDEN S,A	39 506	510 822 €
INDUSTRIVARDEN S,C	34 575	434 163 €
INFIGEN ENERGY	161 203	31 735 €
INFINEON TECHN,	1 153 838	7 071 873 €
INFORMA	472 848	2 617 541 €
INFRATIL	89 400	126 987 €
ING GROEP	2 878 026	20 321 742 €
ING OFFICE FUND	251 653	588 558 €
ING UK REAL ESTATE	149 613	66 404 €
INGENICO	274 627	11 808 961 €
INGERSOLL-RAND	10 551	383 818 €
INLAND REAL ESTATE	15 848	100 733 €
INMARSAT	336 640	2 425 916 €
INNVEST REAL ESTATE	15 910	50 056 €
INPEX HOLDINGS	924	3 708 158 €
INSPUR INTL	570 000	16 176 €
INSUR,AUSTRAL,GRP	418 744	1 546 507 €
INTACT FINANCIAL	22 797	1 124 828 €
INTEL	118 224	1 849 043 €
INTER PARFUMS	56 100	1 299 276 €
INTERCHINA HLDGS	1 050 000	46 753 €
INTERCONTINENTAL HOT	98 856	2 080 473 €
INTERCONTINENTALEX	3 350	314 596 €
INTERPUBLIC GROUP	20 056	167 640 €
INTERROLL HOLD,NOM	6 677	1 842 427 €
INTERTEK GROUP	139 441	5 327 674 €
INTERVEST OFFICES	2 713	54 586 €
INTESA SANPAOLO	7 756 153	10 082 999 €
INTIME DEPARTMENT	156 000	139 532 €
INTL CONSOL,AIRL	225 623	514 057 €
INTL FLAVORS	3 817	192 645 €
INTL GAME TECHN,	13 601	146 182 €
INTL PAPER	236 140	7 135 784 €
INTREPID MINES	98 261	16 249 €
INTUIT	145 204	6 550 414 €
INTUITIVE SURGICAL	1 273	473 484 €
INVENSYS	197 262	790 410 €
INVESCO	14 290	282 787 €
INVESTEC	89 070	465 281 €
INVESTOR SIE B	19 850	393 445 €
INVESTORS REAL ESTA	14 792	97 948 €
INVISTA FOUNDATION	177 910	86 093 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
INVOCARE	21 244	146 880 €
IOOF HOLDINGS	45 977	261 040 €
IPSEN PROMESSE	37 858	862 216 €
IPSOS	60 856	1 713 096 €
IRESS MKT TECHN,	25 228	163 697 €
IRISH CONT, UNIT	66 861	1 293 760 €
IRON MOUNTAIN	16 143	380 188 €
ISUZU MOTORS	566 000	2 537 070 €
ITE GROUP	911 427	2 767 655 €
ITOCU	431 100	3 429 892 €
ITT	9 943	176 929 €
ITV	919 321	1 192 363 €
IVANHOE AUSTRALIA	43 484	16 950 €
IVG IMMOBILIEN	24 971	47 819 €
J,HARD,CHESS UNITS	87 602	629 128 €
JABIL CIRCUIT	12 371	181 005 €
JACOBS ENGINEERING	5 513	178 010 €
JAP,REAL EST,REIT	110	820 175 €
JAP,RET,FD REIT	393	546 753 €
JAPAN AIRLINES CO	88 600	2 875 614 €
JAPAN EXCEL,REIT	33	140 395 €
JAPAN PRIME REIT	167	365 056 €
JAPAN TOBACCO	257 600	5 513 544 €
JARDIN,MATHES,HOLD	54 000	2 539 442 €
JARDINE CYCLE	29 000	867 029 €
JARDINE STRATEGIC	115 500	3 111 772 €
JB HI-FI	19 853	161 807 €
JCDECAUX	64 548	1 160 896 €
JERON,MARTINS ESC,	603 408	8 809 757 €
JFE HOLDINGS	213 800	3 004 453 €
JINCHUAN GROUP INTL	212 000	37 551 €
JM AB	250 000	3 381 214 €
JOHN WOOD CONSO	444 965	3 985 539 €
JOHNSON CONTROLS	18 486	430 041 €
JOHNSON ELECTRIC	368 000	185 824 €
JOHNSON JOHNSON	396 139	21 062 913 €
JOHNSON MATTHEY PL	78 972	2 313 370 €
JOY GLOBAL	4 510	218 179 €
JPMORGAN CHASE	564 251	18 817 968 €
JSR	328 500	4 722 908 €
JU TENG INTERNATIONA	170 000	60 888 €
JULIUS BAER GROUP	10 395	278 481 €
JUNIPER NETWORKS	408 723	6 097 983 €
JX HOLDING INC 1 SEC	231 000	978 711 €
K REIT ASIA REIT	153 550	123 469 €
K S HOLDINGS	10 000	192 807 €
K&S NOM	148 640	5 202 400 €
K,WAH INTL HOLD,	205 000	74 829 €
KABEL DEUTSCHLAND	167 436	9 471 855 €
KADOKAWA GROUP	14 500	291 908 €
KAGARA	142 178	12 875 €
KAI YUAN HOLDINGS	1 440 000	28 184 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
KAISA GROUP HOLDIN	386 000	90 657 €
KAJIMA	928 000	2 311 860 €
KAKAKU,COM	71 600	1 792 512 €
KAKEN PHARMA,	23 000	256 430 €
KANSAS CITY SOUTHN	4 266	270 120 €
KAPSCH TRAFFICCOM	75 000	3 547 500 €
KAROON GAS AUSTRALIA	43 852	183 019 €
KAWASAKI KISEN	1 113 000	1 278 974 €
KAZAKHMYS	44 677	428 538 €
KBC BANCASSURANCE	366 740	9 590 251 €
KDDI	94 300	5 037 605 €
KELLOGG	53 077	2 248 445 €
KENE,REA,INV,REIT	51	134 658 €
KEPPEL	269 700	1 842 099 €
KEPPEL LAND	289 803	725 182 €
KEPPEL TEL	37 000	31 245 €
KERRY GROUP CL,A	325 979	13 057 089 €
KERRY PROPERTIES	277 301	1 092 249 €
KESKO CL,B	98 378	2 436 823 €
KEYCORP	66 913	427 342 €
KILLAM PROPERTIES	13 331	126 841 €
KILROY REALTY CORP	14 866	534 134 €
KIMBERLY CLARK	73 436	4 702 823 €
KIMCO REALTY	118 001	1 729 202 €
KINDER MORGAN	91 851	2 461 389 €
KINDER MORGAN MGNT	64 157	3 672 093 €
KINEPOLIS GROUP	12 415	1 017 906 €
KING STONE ENERGY GR	361 000	19 077 €
KINGBOARD CHEMICAL	135 500	364 650 €
KINGBOARD LAMINATES	180 500	62 883 €
KINGDEE INTL SOFTW	367 200	52 104 €
KINGFISHER	127 852	447 821 €
KINGROSE MINING LT	53 633	35 899 €
KINGSGATE CONSOL,	29 365	101 745 €
KINGSOFT CORP LTD	112 000	59 843 €
KINGSPAN GROUP	639 377	5 324 092 €
KINNEVIK INVEST,B	27 623	437 044 €
KINROSS GOLD	186 075	1 369 303 €
KINTETSU WORLD EXP	85 700	2 160 542 €
KITE REALTY GP TRUST	23 110	97 986 €
KIWI INCOME	434 980	313 014 €
KLA TENCOR	6 037	218 695 €
KLEPIERRE	93 405	2 804 018 €
KLOEVERN	21 107	63 000 €
KOBAYASHI PHARM,	28 800	1 035 789 €
KOHL S	165 256	5 387 366 €
KOMATSU	196 100	3 756 863 €
KOMERI	47 700	913 413 €
KON,BOSKALIS	61 931	2 105 654 €
KON,DSM NOM,	187 469	8 584 206 €
KON,PHILIPS ELEC,	698 318	13 893 037 €
KONE B	199 951	11 157 266 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
KONECRANES A	108 761	2 778 844 €
KONINKLIJKE AHOLD	2 163 845	21 930 569 €
KONINKLIJKE KPN	1 207 488	4 487 025 €
KONINKLIJKE VOPAK	142 288	7 585 373 €
KOWLOON DEV CO	70 000	63 433 €
KRAFT FOODS GROUP	16 120	555 959 €
KROGER	56 621	1 117 475 €
KUBOTA	354 000	3 061 789 €
KUEHNE UND NAGEL	56 529	5 152 627 €
KUNGSLEDEN	24 223	99 978 €
KVAERNER ASA	177 628	392 190 €
KWG PROPERTY HLDGS	231 500	131 849 €
KWS SAAT	14 553	3 529 103 €
KYOCERA	13 000	886 053 €
LABORATORY AMERICA	26 207	1 721 822 €
LADBROKES	560 663	1 370 725 €
LAFARGE	139 428	6 724 612 €
LAFARGE PRIME FID,	60 000	2 896 500 €
LAGARDERE	97 575	2 467 184 €
LAI SUN DEVELOPMEN	2 942 416	87 823 €
LAM RESEARCH	59 033	1 617 766 €
LAND SECURITIES	1 226 558	12 301 873 €
LANXESS	90 982	6 029 377 €
LAS VEGAS SANDS	105 631	3 698 367 €
LASALLE HOTEL	15 936	306 899 €
LAUDER ESTEE CL,A	175 544	7 970 315 €
LAURENT PERRIER	15 000	1 050 000 €
LAWSON	8 700	447 974 €
LEAR CORP	171 210	6 082 734 €
LEASINVEST REAL	573	38 448 €
LEE MAN PAPER	369 000	176 218 €
LEGAL GL GROUP	261 273	469 009 €
LEGG MASON	6 408	125 010 €
LEGGETT AND PLATT	8 275	170 848 €
LEGRAND PROMESSES	178 661	5 694 819 €
LEIGHTON HOLDINGS	34 764	489 472 €
LEM HDG SA REGISTER	9 023	3 775 783 €
LEND LEASE	115 390	843 231 €
LENNAR CL,A	13 200	387 169 €
LENZING	87 310	5 956 288 €
LEUCADIA NATIONAL	7 234	130 535 €
LEXINGTON REALTY	28 274	224 107 €
LI AND FUNG LTD	1 266 000	1 694 822 €
LI NING	157 000	77 435 €
LIBERTY GLOBAL S,A	8 164	389 871 €
LIBERTY GLOBAL S,C	4 003	178 380 €
LIBERTY INTERACT,	47 284	705 817 €
LIBERTY INTERACTIVE	4 066	208 975 €
LIBERTY INTL	578 179	2 496 342 €
LIBERTY MEDIA CAP A	63 424	5 580 869 €
LIBERTY PROP,PB	42 901	1 164 614 €
LIFE TECHNOLOGIES CO	10 260	381 559 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
LIFESTYLE INTL	133 500	248 221 €
LIJUN INTL PHARMA	228 000	51 318 €
LIMITED BRANDS	10 822	386 289 €
LINC ENERGY	74 537	68 673 €
LINCOLN NATIONAL	10 239	201 145 €
LINDE	134 672	17 776 704 €
LINEAR TECHNOLOGY	9 377	243 956 €
LINN ENERGY LLC	7 507	200 657 €
LION SELECTION GROUP	10 477	- €
LION SELECTION NV	62 867	31 684 €
LIONGOLD CORP LTD	199 000	135 303 €
LIPPO-MAPLETREE REAL	326 000	99 187 €
LLOYDS TSB GROUP	910 751	538 018 €
LOBLAW	5 990	191 331 €
L'OCCITANE INTL	86 750	208 413 €
LOEW'S	11 712	362 002 €
LONDON & STAMFORD	129 189	171 700 €
LONDON STOCK EXCH,	33 717	452 276 €
LONGFOR PROPERTIES	213 500	317 157 €
LONKING HLDGS	257 000	51 306 €
LONMIN	304 305	1 066 249 €
LONZA GROUP NOM,	41 382	1 692 588 €
LOOMIS	233 518	2 845 191 €
LORILLARD	4 915	434 946 €
LOTTOMATICA	180 949	3 112 323 €
LOWES	33 449	901 175 €
LSI	40 893	219 291 €
LTC PROPERTIES	5 496	146 696 €
LUK FOOK	90 000	214 900 €
LULULEMON ATHLETIC	5 049	291 934 €
LUNDBECK	49 483	549 811 €
LUNDIN PETROLEUM	70 676	1 231 935 €
LUXOTTICA GROUP	298 462	9 273 214 €
LVMH MOET VUITTON	289 960	40 246 448 €
LYNAS COPORATION	371 413	168 173 €
LYONDELLBASELL IND	13 184	570 900 €
M AND T BANK	5 946	444 101 €
M,D	16 847	51 076 €
M,G,I	163 004	107 180 €
M2 TELECOM	37 275	122 694 €
MACERICH	34 691	1 534 045 €
MACK CALI REALTY	16 356	323 919 €
MACMAHON	330 566	41 183 €
MACQUARIE ATLAS ROAD	90 629	118 826 €
MACQUARIE GROUP	68 326	1 909 512 €
MACY S	345 075	10 213 006 €
MAEDA	60 000	238 947 €
MAGNA INTL CL,A	12 315	466 069 €
MAINFREIGHT	9 380	68 673 €
MAKINO MILLING MACHI	220 000	1 020 877 €
MAKITA	16 600	578 088 €
MAN GROUP	363 474	370 823 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
MAN ORD,	36 761	2 968 451 €
MAN WAH HOLDINGS	56 800	35 908 €
MANPOWER	4 762	153 291 €
MANULIFE FINANCIAL	74 876	770 606 €
MAOYE INTL HOLD,	207 000	32 006 €
MAPFRE	790 963	1 831 079 €
MAPLETREE COMMERC	609 000	459 444 €
MAPLETREE INDUSTRI	462 773	390 792 €
MAPLETREE LOGISTICS	702 694	499 587 €
MARATHON OIL	19 558	454 830 €
MARATHON PETROLEUM	10 638	508 339 €
MARKEL	479	157 470 €
MARKS SPENCER GRP	1 458 913	6 876 371 €
MARRIOTT INTL CL,A	12 603	356 276 €
MARRIOTT VACA WORLD	6 317	199 658 €
MARSH MC LENNAN	137 375	3 591 714 €
MARUBENI	756 000	4 071 789 €
MARUI GROUP	99 800	601 426 €
MARVELL TECHNOLOGY	194 826	1 072 932 €
MASCO	17 322	218 890 €
MASTERCARD CL,A	6 267	2 335 294 €
MATSUSH,ELEC,IND,	157 900	723 016 €
MATTEL	12 323	342 285 €
MAXIM INTEGRATED	11 577	258 164 €
MAYR-MELNHOF	12 867	1 040 683 €
MAZDA MOTOR	1 479 000	2 257 421 €
MC CORMICK NON VTG	72 674	3 501 956 €
MC GRAW HILL ORD,	23 469	973 187 €
MCDERMOTT INTL	11 570	96 709 €
MCDONALDS	96 440	6 452 497 €
MCKESSON	196 116	14 423 094 €
MCMILLAN SHAKESPEA	11 883	129 881 €
MDU RESOURCES GRP	9 755	157 157 €
MEAD JOHNSON NUTRI	16 898	844 515 €
MEADWESTVACO	10 687	258 339 €
MEDIASET	708 297	1 102 110 €
MEDICA	140 800	2 126 080 €
MEDIOBANCA	365 304	1 703 047 €
MEDIOLANUM	243 739	934 495 €
MEDTRONIC	48 626	1 512 924 €
MEDUSA MINING	29 219	124 938 €
MEG ENERGY CORP	7 263	168 421 €
MEGGITT	92 533	436 141 €
MEGMILK SNOW BRAND	37 500	445 066 €
MEKONOMEN AB	147 657	3 555 075 €
MELCO INTL DEV,	251 000	221 311 €
MERCIALYS	10 444	179 115 €
MERCK AND CO, NEW	172 055	5 342 788 €
MERCK KGAA	125 115	12 490 230 €
MERCURY GENERAL	4 958	149 259 €
MERMAID MARINE	48 511	130 264 €
MESOBLAST	45 227	188 757 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
METCASH	178 981	467 924 €
METLIFE	378 709	9 461 980 €
METRO	142 307	2 988 447 €
METROPCS CIONS,	49 134	370 443 €
METSO	150 273	4 814 747 €
MGM CHINA HOLDINGS	149 600	205 250 €
MGM MIRAGE	19 522	172 357 €
MICHAEL KORS HOLD	130 931	5 067 816 €
MICHAEL PAGE INTL	307 000	1 495 068 €
MICHELIN	157 262	11 258 387 €
MICLYN EXPRESS OFFS	47 606	91 846 €
MICROCHIP TECHN,	7 441	183 937 €
MICRON TECHNOLOGY	37 843	181 982 €
MICROPORT SCIENTIF	104 000	41 422 €
MICROSOFT	865 179	17 527 815 €
MID AMERICA APARTM	7 590	372 764 €
MIDAS HOLDINGS	186 000	48 507 €
MIDLAND HOLD	110 000	39 829 €
MINCOR RESOURCES	40 131	31 128 €
MINEBEA	156 000	416 000 €
MINERAL RESOURCES	27 143	207 543 €
MINGFA GROUP INTL	239 000	53 794 €
MINTH GROUP	162 000	141 253 €
MIRABELA NICKEL	176 549	66 732 €
MIRACA HOLDINGS	21 600	658 421 €
MIRAIT HOLDINGS CO	17 100	117 450 €
MIRVAC GROUP	1 322 317	1 546 296 €
MITSU,UFJ LEASE	35 730	1 156 524 €
MITSUB,ELECTRIC	492 000	3 154 842 €
MITSUBISHI	88 700	1 281 482 €
MITSUBISHI CH,HDG	181 000	676 368 €
MITSUBISHI ESTATE	332 775	5 981 193 €
MITSUBISHI GAS	179 000	824 342 €
MITSUBISHI HEAVY	517 000	1 882 061 €
MITSUBISHI TANABE	159 000	1 570 474 €
MITSUBISHI TOKYO	3 591 350	14 522 915 €
MITSUMI	584 500	6 578 189 €
MITSUMI CHEMICALS	334 000	653 351 €
MITSUMI FUDOSAN	333 408	6 112 480 €
MITSUMI MINING	887 000	1 641 728 €
MIXI	635	1 079 500 €
MIZUHO FCIAL GRP	4 075 400	5 612 612 €
MOBILEONE	75 000	126 203 €
MOBIMO	1 132	205 332 €
MOBISTAR	37 724	731 468 €
MODERN TIMES GRP B	18 777	496 090 €
MOHAWK INDUSTRIES	5 768	395 806 €
MOLEX	9 528	197 512 €
MOLEX NON VOT,CL,A	6 514	110 279 €
MOLSON COORS CL,B	19 865	644 739 €
MONADELPHOUS GROUP	18 077	347 618 €
MONDELEZ INTL	761 129	14 694 454 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
MONGOLIA ENERGY	1 012 000	37 138 €
MONGOLIAN MINING	219 000	81 439 €
MONSANTO	151 788	10 897 098 €
MONSTER BEVERAGE	5 111	204 843 €
MOODY S	22 631	863 768 €
MORGAN STANLEY	245 557	3 561 173 €
MORGUARD REAL	11 893	165 616 €
MORI HILLS REIT	40	162 456 €
MORI TRUST SOGO	32	204 070 €
MOTOROLA SOLTN-ED	42 303	1 786 583 €
MPW US	24 565	222 844 €
MTR	352 500	1 052 115 €
MTU AERO ENGINES	192 524	13 245 651 €
MUCKLOW AJ GROUP	5 419	23 734 €
MUNCHENER RUCKVERS	220 127	29 937 272 €
MURATA MFG	101 400	4 491 842 €
MURPHY OIL	6 250	282 302 €
MYER HOLDINGS	114 521	194 791 €
MYLAN	25 108	522 766 €
N,E	250 414	30 565 €
NABORS INDUSTRIES	11 747	128 750 €
NAT,AUSTRALIA BANK	462 738	9 109 733 €
NAT,BANK CANADA	5 239	308 266 €
NAT,HEALTH INVTR	5 097	218 548 €
NATEXIS BQ,POPUL,	694 862	1 771 898 €
NATIONAL GRID TRAN	2 301 543	19 948 030 €
NATIONAL OILWELL	11 297	585 672 €
NATIONAL RETAIL PRO	22 419	530 547 €
NATUREX	39 282	2 239 074 €
NAVITAS	58 819	217 694 €
NCC GROUP PLC	3 300 000	6 214 708 €
NCR	18 406	355 723 €
NEC	643 000	1 020 904 €
NEO-NEON HOLDINGS	134 500	26 456 €
NEPTUNE ORIENT	201 750	143 436 €
NESTE OY	106 814	1 043 573 €
NESTLE NOM,	572 076	28 253 008 €
NET ENTERTAIN B	179 000	1 669 620 €
NETAPP	285 336	7 261 091 €
NETFLIX INC	5 025	352 901 €
NEW GOLD	110 924	930 352 €
NEW HOPE CORP,	49 609	164 465 €
NEW WORLD CHINA LD	986 237	359 028 €
NEW WORLD DEV,	1 784 371	2 098 911 €
NEW WORLD DPT	102 000	49 909 €
NEW YORK COMMUNITY	23 405	232 559 €
NEW ZEALAND O&G	77 139	42 236 €
NEWCREST MING	237 307	4 144 790 €
NEWELL RUBBERMAID	37 000	624 992 €
NEWFIELD EXPLOR,	7 158	145 397 €
NEWMONT MINING	127 300	4 484 081 €
NEWS CL,A	53 914	1 043 193 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
NEWS CL,B	9 178	182 669 €
NEXEN	15 884	321 504 €
NEXT GROUP	115 790	5 294 848 €
NEXTERA ENERGY INC	45 242	2 374 313 €
NHK SPRING	114 800	710 954 €
NIBE INDUSTRIER B	206 600	2 258 272 €
NIDEC	88 100	3 879 491 €
NIELSEN HOLDINGS	21 022	487 760 €
NIEUWE SREEN W010413	6 940	- €
NIEUWE STEEN INV	10 424	63 378 €
NIHON KOHDEN	35 200	808 365 €
NIHON PARKERIZING	118 000	1 277 298 €
NIHON UNISYS	109 400	550 839 €
NII HOLDINGS CL,B	29 496	159 516 €
NIKE CL,B	80 120	3 135 765 €
NIKO RESOURCES	16 782	136 153 €
NIKON	150 900	3 343 626 €
NINE DRAGONS	277 000	189 750 €
NINTENDO	9 500	755 833 €
NIP,BUILD,FD REIT	115	900 833 €
NIPPON ACCOMMODATI	26	136 842 €
NIPPON KAYAKU	89 000	739 325 €
NIPPON SHOKUBAI	207 000	1 601 526 €
NIPPON SODA	55 000	190 088 €
NIPPON STEEL	952 000	1 753 684 €
NIPPON TELEG,TEL,	75 400	2 400 895 €
NIPPON YUSEN	721 000	1 271 237 €
NISOURCE	12 655	238 913 €
NISSAN MOTOR	161 100	1 146 071 €
NISSHINBO INDUS,	221 000	1 403 544 €
NITTO DENKO	120 900	4 475 421 €
NKSJ HOLDINGS 1 SEC	219 600	3 534 789 €
NOBEL BIOCARE NOM,	100 834	648 386 €
NOBIA	1 467 371	4 533 781 €
NOBLE CORP	16 202	427 908 €
NOBLE ENERGY	5 952	459 312 €
NOBLE GROUP	991 090	710 779 €
NOKIA	2 940 026	8 602 516 €
NOKIAN RENKAAT	271 842	8 182 444 €
NOMURA HOLDINGS	724 000	3 194 491 €
NOMURA REAL REIT	56	244 140 €
NOMURA RL ESTATE	13 941	200 310 €
NORDEA BANK	107 349	777 256 €
NORDSTROM	7 199	292 132 €
NORFOLK SOUTHERN	10 893	510 940 €
NORMA GROUP AG	72 917	1 531 257 €
NORSK HYDRO	66 284	251 867 €
NORTH MINING SHARE	2 290 000	114 290 €
NORTHEAST UTIL,	10 678	316 517 €
NORTHERN PTY STP UT	5 315	125 111 €
NORTHERN TRUST	7 669	291 776 €
NORTHWEST HEALTHCA	5 989	56 938 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
NORWEGIAN PROPERTY	88 541	102 573 €
NOVARTIS	569 768	27 123 941 €
NOVO-NORDISK B	219 346	26 944 191 €
NOVOZYMES B NV	233 011	4 971 901 €
NRG ENERGY	18 610	324 518 €
NRW HOLDINGS	54 506	80 692 €
NTT DOCOMO	1 614	1 755 579 €
NTT URBAN DEV,	238	173 698 €
NUANCE CIONS INC,	9 128	154 534 €
NUCOR	10 700	350 282 €
NUFARM	39 243	179 543 €
NUPLEX INDUSTRIES	37 477	74 105 €
NUTRECO HOLDING	98 428	6 309 235 €
NVC LIGHTING HLDG	239 000	47 245 €
NVIDIA	55 170	513 034 €
NVR	198	138 167 €
NWS HOLDINGS	216 451	277 482 €
NYSE EURONEXT	9 527	227 914 €
O REILLY AUTOMOT,	34 905	2 367 419 €
OAKTON	23 106	23 108 €
OBAYASHI	127 000	539 193 €
OCCIDENTAL PETROL,	338 198	19 652 115 €
OCEANS WILSONS	185 000	2 212 428 €
OCEANUS GROUP LTD	201 000	4 119 €
OIL SEARCH	267 215	1 475 059 €
OLAM INTERNATIONAL	361 000	348 559 €
OLAM INTERN-DROIT SS	112 993	- €
OLD MUTUAL	213 707	469 518 €
OLD REP,INTL ORD,	26 619	215 028 €
OM HLGDS LTD	134 395	26 987 €
OMEGA HEALTHCARE	21 929	396 698 €
OMNICARE	183 389	5 021 498 €
OMNICOM GROUP	66 744	2 529 225 €
OMV	289 780	7 926 932 €
ON SEMICONDUCTOR	486 700	2 602 575 €
ONEOK	7 103	230 320 €
O-NET COMMUNICATIO	122 000	25 788 €
ORACLE	825 434	20 861 242 €
OREAL	347 909	36 495 654 €
ORICA	73 635	1 453 681 €
ORIENT OVERSEAS	50 000	245 628 €
ORIENTAL PRESS GRP	182 000	15 673 €
ORIGIN ENERGY	219 187	2 005 633 €
ORION CL,B	368 095	8 164 347 €
ORIX	103 130	8 766 050 €
ORIX JREIT REIT	269	1 004 031 €
ORKLA S,A	53 392	352 929 €
ORPEA	155 250	5 200 875 €
OSAKA SEC,EXCHANGE	5 700	215 000 €
OSG	19 900	207 903 €
OSIM INTERNATIONAL	69 000	74 120 €
OSISKO MINING	83 475	508 722 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
OTSUKA	61 900	3 540 246 €
OUTOKUMPU CL,A	3 787 157	3 007 003 €
OUTOTEC	130 000	5 508 100 €
OVERS,CHINESE BKG	519 200	3 136 800 €
OWENS-ILLINOIS	9 813	158 315 €
OZ MINERALS	61 999	327 107 €
P,P,G,INDUSTRIES	4 810	493 806 €
PACCAR	11 148	382 282 €
PACIFIC ANDES RES	333 000	28 120 €
PACIFIC BASIN	386 000	164 316 €
PACIFIC BRANDS	186 625	91 115 €
PACIFIC TEXTILES	87 000	59 256 €
PADDY POWER	84 000	5 250 000 €
PAGESJAUNES	229 171	428 550 €
PALADIN ENERGY	161 255	130 792 €
PALL	122 863	5 615 689 €
PAN AMER,SILVER	9 581	136 048 €
PANAUST LTD	125 080	328 976 €
PANORAMIC RES,	40 876	15 450 €
PARAMOUNT BED HDG	23 400	531 016 €
PARGESA HOLDING	5 064	262 893 €
PARK24	95 200	1 139 895 €
PARKER-HANNIFIN	95 764	6 178 463 €
PARKSON RETAIL GROUP	280 500	171 560 €
PARKWAY LIFE REAL	95 000	126 824 €
PARKWAY PROPERTIES	8 099	85 941 €
PARMALAT	742 373	1 306 576 €
PARTNERRE	5 534	337 858 €
PARTNERS GROUP NOM	72 387	12 668 325 €
PATRIZIA IMMOBIL,	10 242	66 163 €
PATTERSON CIES	6 707	174 136 €
PATTERSON-UTI	23 070	325 997 €
PAYCHEX	162 698	3 837 916 €
PCCW	1 109 000	368 990 €
PCD STORES (GROUP)	620 000	57 033 €
PCFIC RUB EGY	17 934	315 727 €
PEABODY ENERGY	9 295	187 606 €
PEAK SPORT PRODUCTS	169 000	24 973 €
PEARSON	819 132	11 997 643 €
PEBBLEBROOK HOTEL	9 267	162 369 €
PEMBINA PPLN INC TR	60 362	1 308 679 €
PENN REAL ESTATE	9 837	131 618 €
PENN WEST ENERGY	20 449	168 240 €
PENNEY (J,C,)	11 781	176 125 €
PENNON GROUP	464 167	3 576 678 €
PENTA OCEAN CONST,	221 000	449 754 €
PEOPLES UNITED	100 841	924 733 €
PEPCO HOLDINGS	13 424	199 670 €
PEPSICO	108 842	5 649 316 €
PERENNIAL CHINA RE	166 000	58 237 €
PERNOD-RICARD	225 461	19 714 310 €
PERPETUAL	8 267	226 156 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
PERRIGO	18 384	1 450 613 €
PERSEUS MINING	92 610	153 147 €
PERSIMMON	344 800	3 400 814 €
PETROFAC	58 395	1 168 476 €
PETROLIERE IMP,	10 105	328 930 €
PETSMART	102 068	5 290 752 €
PEUGEOT S,A,	197 763	1 081 961 €
PFEIFFER VACUUM	166 278	15 226 076 €
PFIZER	1 338 688	25 465 229 €
PG AND E	250 822	7 644 135 €
PHARMAXIS,LTD	59 447	58 047 €
PHILIP MORRIS	220 604	13 995 236 €
PHILLIPS 66	119 760	4 823 465 €
PHOENIX SATELLITE TV	302 000	74 180 €
PIEDMONT OFFICE REAL	32 254	441 584 €
PINAULT PRINTEMPS	76 430	10 765 166 €
PINNACLE WEST	5 718	221 104 €
PIONEER NAT,RES,	3 924	317 248 €
PIRELLI & C	181 369	1 569 749 €
PITNEY BOWES ORD,	32 678	263 724 €
PLAINS EXPLORATION	6 332	225 443 €
PLATINUM AM	44 876	140 293 €
PLUM CREEK TIMBER	13 119	441 512 €
PMS	20 798	31 118 €
PNC FIN,SCES GROUP	23 829	1 053 905 €
POINT	38 060	1 053 327 €
POLYTEC ASSET	255 000	26 452 €
PORSHE AUTOMOBILE	125 969	7 772 287 €
PORTS DESIGN	84 500	50 938 €
PORTUGAL TELE,NOM,	1 006 576	3 773 653 €
POST PROPERTIES	9 930	376 216 €
POSTNL NV	368 894	1 076 433 €
POTASH SASKATCHEW,	21 303	656 925 €
POU SHENG INTL HDG	336 000	14 961 €
POWER CORP,CANADA	18 044	348 866 €
POWER FINANCIAL	13 088	271 591 €
POWERLONG REAL EST	320 000	51 670 €
PPL	68 690	1 491 653 €
PRADA	103 600	749 726 €
PRAXAIR	9 600	796 966 €
PREC,CASTPARTS	4 811	691 216 €
PREMER INVT LTD	23 259	120 150 €
PREMIER INVESTMENT	35	97 785 €
PREMIER OIL	553 356	2 295 701 €
PRI HEALTH CARE	103 392	325 670 €
PRICE T ROWE GROUP	93 927	4 639 149 €
PRICELINE,COM	1 480	696 433 €
PRIMARIS RETAIL	16 411	336 296 €
PRIMARY HEALTH	11 220	48 139 €
PRIME OFFICE AG	14 335	46 445 €
PRINCIPAL FCIAL	10 022	216 799 €
PROCTER GAMBLE	142 165	7 320 678 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
PROGRESSIVE	19 382	310 194 €
PROLOGIS	107 970	2 988 338 €
PROSAFE	2 218 145	14 305 542 €
PROSPERITY REAL	311 000	71 521 €
PROTHENA CORP PLC	10 044	55 842 €
PRUDENTIAL	1 081 089	11 535 970 €
PRUDENTIAL FCIAL	12 159	491 838 €
PRYSMIAN	516 311	7 749 828 €
PS BUSINESS PARKS	3 309	163 091 €
PSP SWISS PROPERTY	12 833	920 365 €
PUBLIC POWER CORP	143 409	844 679 €
PUBLIC SCE ENT,	15 304	355 205 €
PUBLIC STORAGE	41 450	4 557 488 €
PUBLICIS GROUPE	113 438	5 133 070 €
PUMA R,RUDOLF ECH,	26 652	5 992 702 €
QANTAS AIRWAYS	218 579	256 463 €
QBE INS,GROUP	240 902	2 067 747 €
QEP RESOURCES	7 134	163 794 €
QIAGEN	715 336	9 835 870 €
QUALCOMM	254 548	11 943 445 €
QUBE LOGISTICS HOL	144 602	190 730 €
QUEST DIAGNOSTICS	38 700	1 710 444 €
QUESTAR	10 882	163 098 €
QUINTAIN ESTATES	148 434	97 449 €
RAFFLES MEDICAL GP	51 000	82 968 €
RAFLES EDUCATION NV	165 999	35 045 €
RAIFFEIS,INTL BK	48 596	1 528 587 €
RAKUTEN	909 300	5 376 037 €
RALPH LAUREN A	2 284	259 722 €
RAMCO GERSHENS,PB	6 713	67 772 €
RAMELIUS RESOURCES	76 691	26 572 €
RAMIRENT OYJ	273 814	1 711 338 €
RAMSAY HEALTH CARE	30 714	659 798 €
RANDGOLD RESOURCES	192 128	14 093 966 €
RANDSTAD PROV,DIV,	93 514	2 600 157 €
RANGE RESOURCES	13 113	624 916 €
RATIONAL	40 000	8 720 000 €
RATOS FORVALTN,S,B	55 440	403 997 €
RAUTARUUKKI	128 301	764 032 €
REAL GOLD MINING LTD	90 500	78 024 €
REAL NUTRICEUTICAL	89 000	24 561 €
REALESTATE,COM,AU	10 376	147 073 €
REALTY INCOME	86 384	2 634 633 €
RECKITT BENCKISER	288 001	13 773 343 €
RED ELECTRICA	79 383	2 960 986 €
RED HAT	5 854	235 155 €
REED ELSEVIER	1 460 125	14 366 831 €
REGAL HOTELS INTL	82 000	28 487 €
REGENCY CENTERS	32 688	1 168 279 €
REGENERON PHARM,	4 422	573 780 €
REGENT PACIFIC GRP	391 000	7 691 €
REGIONS FINANCIAL	62 205	336 409 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
REGIS RESOURCES	89 862	361 599 €
REJECT SHOP LTD	5 195	61 036 €
REMY COINTREAU	44 217	3 658 072 €
RENAISSANCE RE HLD	32 452	2 000 189 €
RENAULT	191 064	7 773 439 €
RENHE COMMERCIAL	2 178 000	172 642 €
RENISHAW PLC	414 264	10 572 389 €
RENTOKIL INITIAL	569 023	671 729 €
REPSOL YPF	606 302	9 297 641 €
REPSOL YPF DO12	170 001	78 540 €
REPUBLIC SCES	116 683	2 595 807 €
RESEARCH IN MOTION	28 692	257 915 €
RESOLUTION	1 017 385	3 104 460 €
RESONA HOLDINGS	626 900	2 155 656 €
RESTAURANT GROUP	923 100	4 403 247 €
RETAIL OPPORTUNITY	8 731	85 110 €
REX MINERALS	29 393	15 045 €
REXAM	958 218	5 150 820 €
REXEL PROMESSES	96 620	1 491 813 €
REXLOT HOLDINGS	1 175 000	67 841 €
REYNOLDS AMERICAN	56 713	1 782 175 €
RICHEMONT CIE FINAN	138 710	8 206 740 €
RIETER HOLDING	31 367	4 143 106 €
RIGHTMOVE	362 000	6 408 975 €
RIO TINTO	87 736	4 560 559 €
RIO TINTO NOM,	229 597	9 939 956 €
RIOCAN REAL UNIT	79 455	1 668 149 €
RLJ LODGING TR SBI	19 700	289 433 €
RM	132 298	170 855 €
ROAD KING	59 000	39 088 €
ROBERT HALF INTL	7 814	188 593 €
ROC OIL COMPANY	125 804	43 589 €
ROCHE HOLDING BJ	152 662	23 276 274 €
ROCKWELL AUTOMAT,	4 927	313 880 €
ROCKWELL COLLINS	7 847	346 223 €
ROCKWOOL INTL S,B	65 171	5 537 919 €
ROGERS CIONS CL,B	48 864	1 681 038 €
ROHTO PHARM,	225 000	1 987 500 €
ROLLS ROYCE HOLDIN	302 605	3 258 852 €
ROPER INDUSTRIES	91 949	7 774 935 €
ROSS STORES	25 541	1 047 871 €
ROTORK PLC	333 924	10 477 581 €
ROUSE PROPERTIES	14 413	184 973 €
ROVI CORP	12 737	149 069 €
ROWAN CIES	7 025	166 620 €
ROYAL BANK CANADA	33 970	1 549 572 €
ROYAL BK SCOT, GRP	127 865	511 555 €
ROYAL CARIBBEAN	3 884	100 164 €
ROYAL DUTCH SHELL	1 438 878	38 048 045 €
RPC GROUP	278 163	1 361 493 €
RPS GROUP PLC	1 000 000	2 612 502 €
RSA INSURANCE GRP,	4 280 471	6 633 648 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
RUBIS	58 721	3 041 748 €
RWE	387 511	12 105 844 €
RYANAIR HOLDINGS	2 359 273	11 152 283 €
RYDER SYSTEM	7 052	267 071 €
RYOHIN KEIKAKU	34 100	1 443 268 €
S,E	32 801	66 640 €
S,R	591 155	172 240 €
S,S LTD	33 423	76 326 €
SA SA INTERNATIONAL	168 000	104 561 €
SABANA SHARIAH CO	124 000	87 774 €
SABMILLER	184 405	6 422 687 €
SABRA HEALTH CARE	6 444	106 162 €
SAFESTORE HOLDING	30 734	40 923 €
SAFEWAY	43 329	594 525 €
SAF-HOLLAND SA	202 430	1 059 721 €
SAFRAN	227 786	7 424 685 €
SAGE GRP DIVISION	175 404	636 437 €
SAIC	153 709	1 319 771 €
SAINSBURY	1 362 794	5 798 301 €
SAINT-GOBAIN	347 105	11 183 723 €
SAIPEM	360 811	10 571 762 €
SAIZERIYA	86 700	901 224 €
SALESFORCE,COM	5 512	702 797 €
SALVATORE FERRAGAM	280 135	4 661 446 €
SALZGITTER	37 823	1 491 172 €
SAMPO A	935 548	22 771 238 €
SAMSONITE INTL SA	141 300	220 965 €
SANDFIRE RESOURCES	24 281	165 009 €
SANDISK	10 719	353 668 €
SANDS CHINA	486 800	1 617 315 €
SANDVIK	30 491	367 948 €
SANOFI AVENTIS	1 267 246	90 468 692 €
SANOMA-WSOY	62 430	464 167 €
SANTOS	193 159	1 688 373 €
SANY HEAVY EQUIPME	183 000	72 529 €
SAP SYSTEME ORD,	967 007	58 687 655 €
SAPUTO	9 296	356 275 €
SARACEN MINERAL	120 532	36 068 €
SAUL CENTERS	2 548	82 698 €
SBM OFFSHORE	159 114	1 673 084 €
SCAG	30 413	237 815 €
SCANA	15 236	527 436 €
SCANIA S,A	6 334	97 852 €
SCANIA S,B	31 310	490 268 €
SCHEIN HENRY	10 985	670 065 €
SCHIBSTED	152 700	4 901 168 €
SCHINDLER HOLD,BP	84 330	9 224 030 €
SCHINDLER HOLD,NOM	108 113	11 628 329 €
SCHLUMBERGER ORD	96 179	5 055 423 €
SCHNEIDER ELECTRIC	469 826	25 760 560 €
SCHOELLER BLECKM,	173 355	13 745 318 €
SCHRODERS	23 304	484 411 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
SCHRODERS N,VOTING	17 590	295 371 €
SCHWAB CHARLES	437 120	4 761 107 €
SCOR REGPT	595 405	12 152 216 €
SCOTT,SOUTH,ENERGY	1 145 082	20 018 817 €
SCRIPPS NETWORKS	6 986	306 909 €
SEADRILL	14 945	414 098 €
SEAGATE TECHNOLOGIE	34 317	791 811 €
SEALED AIR	18 582	246 792 €
SEARS HOLDINGS	4 096	128 497 €
SEB	21 792	1 214 032 €
SECURITAS S,B	142 575	942 543 €
SEEK	69 747	384 463 €
SEGRO NV09	393 307	1 195 777 €
SEI INVESTMENTS	7 455	131 978 €
SEMBCORP IND,	182 000	593 294 €
SEMBCORP MARINE	167 000	476 995 €
SEMICOND,MFG INTL	4 758 000	179 263 €
SEMPRA ENERGY	7 721	415 449 €
SENX ENERGY LTD	248 189	135 831 €
SENIOR HOUSING	35 337	633 622 €
SERCO GROUP	1 701 088	11 220 344 €
SES GLOBAL FDR	803 453	17 434 930 €
SEVEN GRP HOLDINGS	23 746	158 007 €
SEVEN WEST MEDIA	69 757	90 087 €
SEVERN TRENT	394 390	7 653 432 €
SG	39 227	130 664 €
SGS NOM,	11 627	19 519 640 €
SHAFTESBURY	1 705 387	11 816 391 €
SHANGRI LA ASIA	316 833	478 721 €
SHAW CIONS CL,B	77 427	1 347 172 €
SHENGUAN HOLDINGS	196 000	80 366 €
SHENZHOU INTL	76 000	130 154 €
SHERWIN-WILLIAMS	4 808	560 958 €
SHIMADZU	514 000	2 646 649 €
SHIMAO PROPERTY	539 733	772 202 €
SHIN-ETSU CHEMICAL	85 000	3 899 561 €
SHINSEI BANK	601 000	901 500 €
SHIRE	450 034	10 469 907 €
SHOPPERS DRUG MART	22 424	731 125 €
SHOPPING CENT AU	111 530	131 739 €
SHOWA	134 200	1 000 614 €
SHUI ON LAND	1 176 804	431 857 €
SHUN TAK HOLDINGS	459 250	188 307 €
SHW AG	38 316	1 109 440 €
SIA ENGINEERING	47 000	128 115 €
SIEMENS	591 296	48 604 531 €
SIGMA PHARMA,	234 577	135 770 €
SIGMA-ALDRICH	4 533	252 987 €
SIHUAN PHARMACEUTI	306 000	101 813 €
SIKA POR,	2 718	4 752 221 €
SILIC	32 054	2 678 112 €
SILVER BASE GROUP	96 350	23 572 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
SILVER LAKE	31 098	77 139 €
SILVER LAKE RESOUR	42 384	110 808 €
SILVER WHEATON	27 488	750 910 €
SIMCORP	16 849	2 854 461 €
SIMON PROPERTY GRP	69 751	8 363 877 €
SIMS	42 297	308 093 €
SINGAMAS CONTAINER	362 000	65 537 €
SINGAPORE AIRLINES	119 000	794 319 €
SINGAPORE AIRPORT	164 890	295 891 €
SINGAPORE EXCHANGE	215 000	935 827 €
SINGAPORE POST	300 000	214 219 €
SINGAPORE PRESS	309 000	773 220 €
SINGAPORE TELECOM,	1 602 000	3 282 583 €
SINO BIOPHARMA	496 000	179 592 €
SINO LAND	1 148 828	1 567 192 €
SINO OIL AND GAS H	2 690 000	51 069 €
SINOLINK WORLDWIDE	536 000	36 192 €
SINOPOLY BATTERY L	1 080 000	31 178 €
SIRIUS XM RADIO INC	1 046 434	2 293 837 €
SJM HLDGS LTD	443 000	780 334 €
SKANDINAV,ENSK,A	76 639	493 693 €
SKANSKA S,B	24 115	298 598 €
SKF S,B LIBRE	98 399	1 872 344 €
SKY CITY ENTERT,	113 260	267 895 €
SKY NETWORK TV	38 016	116 562 €
SKYWORTH DIGITAL	446 000	173 273 €
SL GREEN REALTY	17 938	1 042 891 €
SLIGRO FOOD GROUP	207 159	4 505 708 €
SLM	32 438	421 468 €
SM ENERGY	66 300	2 625 548 €
SMA SOLAR TECHNOLO	16 198	307 924 €
SMARTONE TELECOM,	106 000	146 054 €
SMC	20 200	2 757 123 €
SMITH NEPHEW	618 428	5 180 888 €
SMITHFIELD FOODS	16 219	265 355 €
SMITHS GROUP	45 452	667 406 €
SMRT CORP,	152 000	159 031 €
SMS MT	13 325	48 582 €
SMUCKER	95 487	6 246 055 €
SNAM RETE GAS	5 693 420	20 006 678 €
SNC LAVALIN	6 002	184 353 €
SOCAM DEVELOPMENT	30 316	25 929 €
SOCIETE GENERALE A	502 047	14 228 012 €
SODEXHO ALLIANCE	185 349	11 810 438 €
SOFTBANK	340 850	9 388 325 €
SOFTWARE	148 568	4 769 776 €
SOHO CHINA LTD	796 904	485 066 €
SOLVAY	33 793	3 695 265 €
SO-NET M3	738	892 074 €
SONIC HEALTHCARE	79 235	831 721 €
SONOVA HOLDING NOM	39 425	3 312 641 €
SONY	390 600	3 282 411 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
SONY FIN,HOLD,	190 700	2 576 123 €
SORIN	413 115	693 620 €
SOUTHERN	159 586	5 181 945 €
SOUTHERN COPPER	9 846	282 744 €
SOUTHERN CROSS MED	104 096	86 070 €
SOUTHWEST AIRLINES	28 099	218 245 €
SOUTHWEST,ENERGY	25 815	654 186 €
SOVRAN SELF	5 329	251 009 €
SP AUSNET UNITS	336 740	294 339 €
SPARK INFRASTRUCT,	277 935	365 502 €
SPARKLE ROLL GROUP	440 000	29 710 €
SPECTRA ENERGY	107 077	2 223 732 €
SPECTRIS	265 265	6 701 122 €
SPIRAX-SARCO ENG,	201 407	5 631 748 €
SPIRIT REALTY CAP	5 324	71 800 €
SPONDA	51 438	185 177 €
SPRINGLAND INTL	147 000	59 412 €
SPRINT FON COM,S,1	171 550	737 780 €
SPX	9 455	503 086 €
SRE GR	626 285	24 209 €
SSAB SVENSKT S,A	67 747	446 681 €
SSAB SVENSKT S,B	58 807	330 553 €
ST BARBARA	97 350	110 773 €
ST JUDE MEDICAL	28 341	776 884 €
ST MODWEN PROP,	25 257	71 527 €
ST TELEMEDIA ORD	60 829	124 063 €
ST, JAMES S PLACE	525 254	2 729 559 €
STAG INDUSTRIAL	8 337	113 635 €
STAGECOACH GROUP NV	2 011 672	7 619 105 €
STALLERGENES	45 000	1 935 000 €
STANDARD CHARTERED	318 754	6 183 694 €
STANDARD LIFE	126 955	519 810 €
STANLEY BLACK DECKER	8 031	450 586 €
STAPLES	241 692	2 089 873 €
STARBUCKS	228 164	9 281 277 €
STARHILL GLOBALREIT	114 000	55 567 €
STARHUB	136 000	320 050 €
STARPHARMA HOLDING	55 227	56 536 €
STARWOOD HOTELS	6 626	288 279 €
STATE STREET	79 097	2 820 350 €
STATOILHYDRO	625 319	11 846 391 €
STEDIM	48 400	3 552 560 €
STELLA INTL HOLDINGS	48 000	98 643 €
STERICYCLE	45 658	3 230 414 €
STMICROELECTRONICS	577 861	3 101 958 €
STOCKLAND	885 400	2 461 188 €
STORA ENSO S,R	473 102	2 481 420 €
STOREBRAND	451 652	1 650 944 €
STRABAG	42 090	859 688 €
STRATEC BIOMEDICAL	143 721	5 410 377 €
STRATEGIC HOTELS	33 841	164 277 €
STRAUMANN HOLDING	5 857	543 573 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
STRYKER	8 056	334 974 €
STW CIONS GROUP	92 906	81 208 €
STX OSV HOLDINGS	116 000	93 636 €
SUDZUCKER	90 146	2 793 625 €
SUEZ ENVIRON,COMP, SULZER	299 877 62 758	2 731 580 € 7 493 725 €
SUMITOMO REALTY	267 444	6 679 062 €
SUMITOMO CHEMICAL	1 028 000	2 425 719 €
SUMITOMO METAL	105 000	1 112 632 €
SUMITOMO MITSUI	523 900	14 315 338 €
SUMITOMO RUBBER	345 500	3 136 776 €
SUN ART RETAIL GRO	579 500	674 846 €
SUN COMMUNITIES	4 816	145 715 €
SUN HUNG KAI PROP,	764 735	8 696 038 €
SUN LIFE FINANCIAL	28 894	580 433 €
SUNCOR ENERGY	139 703	3 481 134 €
SUNCORP GROUP	258 887	2 073 298 €
SUNLAND GROUP	20 949	16 744 €
SUNLIGHT REIT	236 000	76 213 €
SUNSTONE HOTEL	21 550	175 061 €
SUNTEC REAL ESTATE	861 934	896 454 €
SUNTRUST BANKS	152 151	3 271 754 €
SUPER GROUP	82 000	164 967 €
SUZUKI MOTOR	96 100	1 889 967 €
SVENSKA CELLULOS,B	85 304	1 402 372 €
SVENSKA HANDELBK A	14 231	385 608 €
SWATCH GROUP NOM,	11 007	718 264 €
SWATCH GROUP POR,	12 161	4 647 542 €
SWEDBANK A	118 532	1 755 149 €
SWEDISH MATCH	51 711	1 315 565 €
SWIBER HOLDINGS	77 000	29 165 €
SWIRE PACIFIC CL,A	182 000	1 707 135 €
SWIRE PROPERTIES	441 350	1 116 473 €
SWISS LIFE HO,NOM,	5 533	556 601 €
SWISS PRIME SITE	265 934	16 824 711 €
SWISS RE	7 499	409 500 €
SWISSCOM NOM,	60 500	19 742 211 €
SWISSQUOTE GROUP	63 200	1 503 016 €
SYDNEY AIRPORT UNITS	148 856	396 199 €
SYMANTEC	257 118	3 670 328 €
SYMRISE	128 388	3 481 883 €
SYNEAR FOOD HLDGS	244 000	28 180 €
SYNERGY HEALTH	70 561	949 107 €
SYNGENTA NOM,	66 281	20 134 749 €
SYNOPSIS	85 889	2 073 961 €
SYSCO	24 267	582 747 €
SYSMEX	59 100	2 055 539 €
T AND D	362 000	3 305 632 €
TABCORP HOLDINGS	145 683	349 896 €
TADANO	136 000	860 140 €
TAG TEGERNSEE IMMO	371 417	3 526 604 €
TAIHEIYO CEMENT	2 211 000	4 577 158 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
TAISEI	1 090 000	2 734 561 €
TALISMAN ENERGY	34 648	296 938 €
TANGER FACTORY OUT	19 432	504 076 €
TAP OIL	51 904	25 545 €
TARGET	208 402	9 353 115 €
TAT HONG	59 000	49 640 €
TATE LYLE	317 760	2 985 244 €
TATTS GROUP	279 480	662 442 €
TAUBMAN CENTERS	12 493	745 941 €
TCC INTL HOLD,	200 000	43 450 €
TCL COMM TECH HLDG	107 000	25 340 €
TD AMERITRADE HLDG	42 736	544 897 €
TDC	1 987 439	10 665 736 €
TDK	96 400	2 629 860 €
TE CONNECTIVITY LTD	13 819	389 079 €
TECH PRO TECHNOLOG	152 000	42 244 €
TECHNIP	74 457	6 465 846 €
TECHNOPOLIS	20 495	77 266 €
TECHTRONIC INDUST,	281 000	394 880 €
TECK COMINCO CL,B	14 886	409 941 €
TECMO KOEI HOLDING	22 000	139 912 €
TECNICAS REUNIDAS	68 000	2 385 780 €
TECO ENERGY	11 712	148 887 €
TEL,ERICSSON S,B	337 371	2 560 728 €
TELE2 S,B	66 799	912 014 €
TELECITY GROUP PLC	200 000	1 939 342 €
TELECOM ITAL,EPAR,	15 461 985	9 238 536 €
TELECOM ITAL,ORD,	11 832 491	8 081 591 €
TELECOM NEW ZEALD	383 830	546 407 €
TELEFONICA	2 918 831	29 742 888 €
TELEFONICA DEUTSCH	143 133	826 450 €
TELEKOM AUSTRIA	480 580	2 758 529 €
TELENET GROUP HOLD	203 170	7 243 011 €
TELENOR	584 083	8 931 760 €
TELEPH DATA SYST NV	6 768	113 656 €
TELEVISION BROADC,	66 000	373 961 €
TELIASONERA	2 008 124	10 315 962 €
TELSTRA	882 258	3 036 040 €
TELUS	6 905	342 436 €
TELUS N,VTG	24 355	1 200 032 €
TEN NETWORK HOLD,	468 931	107 087 €
TEN NETWORK HOLDG DS	208 413	- €
TENARIS	322 744	5 028 352 €
TENCENT HOLD	185 000	4 507 912 €
TERADATA	8 811	413 617 €
TERNA	4 665 235	14 107 671 €
TERUMO	79 200	2 365 579 €
TESCO	3 226 606	13 366 288 €
TEXAS INSTRUMENTS	29 568	692 776 €
TEXWINCA HOLD,DIV,	134 000	95 595 €
TF1	145 031	1 283 524 €
T-GAIA	9 900	70 863 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
TGS-NOPEC GEOPHYS,	730 579	18 072 301 €
THALES	130 285	3 419 330 €
THE LINK REIT	891 652	3 376 842 €
THE MOSAIC	13 605	584 383 €
THERMO FISHER	15 551	752 308 €
THK	53 300	718 147 €
THOMSON REUTERS	33 994	745 294 €
THORN GROUP LIMITE	28 682	45 850 €
THYSSENKRUPP	277 308	4 924 990 €
TIANNENG POWER INTL	164 000	79 924 €
TIFFANY	4 886	212 502 €
TIGER AIRWAYS HLDG	79 500	35 542 €
TIGER RESOURCES	116 613	27 089 €
TIM HORTONS	46 494	1 729 490 €
TIME WARNER	205 079	7 440 025 €
TIME WARNER CABLE-WI	19 670	1 450 036 €
TINGYI HOLDING	448 000	944 778 €
TITAN PETROCHEMICALS	780 000	18 777 €
TJX COS	52 743	1 698 225 €
TNT EXPRESS NV	294 238	2 480 426 €
TOD S GROUP	25 000	2 391 250 €
TOEI	60 000	236 316 €
TOKAI CARBON	197 000	620 377 €
TOKAI TOKYO SECU,	226 000	777 123 €
TOKIO MARINE HOLD,	309 700	6 473 817 €
TOKYO ELECTRON	46 500	1 605 066 €
TOKYO TATEMONO	59 082	227 518 €
TOKYU LAND	238 088	1 307 396 €
TOKYU REIT	22	90 798 €
TOLL BROTHERS	18 652	457 387 €
TOLL HOLDINGS	144 554	519 069 €
TOM TAILOR HOLDING	175 951	2 836 330 €
TOMY	62 600	261 932 €
TOP REIT	37	120 575 €
TOPDANMARK	24 000	3 901 890 €
TOPPAN FORMS	40 000	271 228 €
TORAY INDUSTRIES	656 000	3 032 561 €
TORCHMARK	4 942	193 684 €
TORONTO DOMIN BANK	22 183	1 415 271 €
TOSHIBA	748 000	2 211 193 €
TOSHIBA TEC	121 000	463 833 €
TOTAL FINA	1 972 497	76 947 108 €
TOTAL SYSTEM SERV,	106 091	1 723 657 €
TOUR EIFFEL	1 700	75 650 €
TOWA PHARMACEUTICA	26 200	1 041 105 €
TOWER	38 450	46 435 €
TOWNGAS CHINA	144 000	89 765 €
TOX FREE SOLUTIONS	21 885	50 839 €
TOYO SUISAN KAISHA	20 000	403 158 €
TOYOTA MOTOR	684 900	24 061 618 €
TPV TECHNOLOGY	198 000	40 496 €
TRANSALTA	25 906	298 392 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
TRANSCANADA	110 577	3 960 791 €
TRANSFIELD SCES	111 425	171 099 €
TRANSOCEAN LTD	6 150	205 578 €
TRANSPACIFIC IND,	231 445	142 159 €
TRANSURBAN UNIT	294 670	1 413 135 €
TRAVELERS COS,	172 510	9 397 503 €
TREASURY WINE EST	131 661	486 251 €
TRINITY	258 000	127 754 €
TRIPADVISOR	6 060	192 684 €
TRİYARDS HOLDING	14 940	6 911 €
TROY RESOURCES	17 100	48 746 €
TRULY INTL HLDGS	231 000	39 560 €
TRYGVESTA	300 385	17 171 184 €
TSUKUI	48 200	685 793 €
TUI NOM,	160 931	1 263 147 €
TUI TRAVEL	212 703	740 828 €
TULLOW OIL	43 298	673 145 €
TURQUOISE HILL	21 440	124 129 €
TYCO FLOW	77 943	2 905 718 €
TYCO INTL	264 801	5 874 870 €
TYSON FOODS CL,A	39 756	585 002 €
U S BANCORP	381 515	9 242 710 €
U STORE IT TRUST	22 513	248 797 €
UBI BANCA	1 443 644	5 061 416 €
UBS NOM,	264 234	3 124 477 €
UCB	302 531	13 075 390 €
UDR	46 566	839 912 €
UK COMMERCIAL	133 510	108 309 €
ULTRA ELECTRONICS	275 893	5 660 041 €
ULTRA PETROLEUM	15 884	218 429 €
UMICORE	176 567	7 361 078 €
UNIBAIL	143 621	26 131 841 €
UNICREDIT	2 885 467	10 693 541 €
UNILEVER	2 707 435	78 333 591 €
UNION PACIFIC ORD,	118 040	11 256 059 €
UNI-PRESIDENT CHINA	217 000	174 344 €
UNIT 4 AGRESSO	273 754	6 214 216 €
UNITE GROUP	27 427	93 430 €
UNITED BUSINESS	219 762	1 950 791 €
UNITED COMPANY RUS	240 000	115 083 €
UNITED CONTINENTAL	7 527	133 481 €
UNITED ENERGY GROUP	770 000	105 493 €
UNITED ENGINEERS	52 000	108 811 €
UNITED GROUP	33 104	283 622 €
UNITED LABORATORIE	95 000	34 491 €
UNITED OVS BK LCL	390 000	4 797 206 €
UNITED PARCEL CL,B	90 291	5 049 420 €
UNITED TECHNO,	24 938	1 551 248 €
UNITED UTILITIES	1 622 493	13 472 433 €
UNITEDHEALTH GROUP	165 214	6 797 032 €
UNIV,HEAL,SCE CL,B	16 163	592 750 €
UNIVERSAL HEALTH	2 187	83 953 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
UNUM GROUP	11 182	176 585 €
UOB-KAY HIAN HOLD,	57 000	57 513 €
UOL GROUP	212 000	785 868 €
UPM KYMMENE	368 677	3 246 201 €
URBAN OUTFITTERS I	18 774	560 486 €
URSTADT BIDDLE A	3 510	52 394 €
UTD INTERNET NOM,	310 381	5 062 314 €
UTD STATES STEEL	8 377	151 541 €
UTD URB,INV,REIT	452	393 319 €
VACON OYJ	245 038	9 850 528 €
VALEANT PHARM INTL	11 726	530 068 €
VALEO	142 992	5 381 504 €
VALERO ENERGY	132 989	3 441 736 €
VALLOUREC	100 547	3 970 601 €
VALUE PARTNERS GRP	171 000	85 678 €
VARIAN MEDICAL SYS	5 252	279 809 €
VARITRONIX INTL	85 000	25 703 €
VASTNED RETAIL	3 302	108 141 €
VECTOR LIMITED	59 193	100 748 €
VEDANTA RESSOURCE	35 634	508 304 €
VEECO INSTRUMENTS	36 643	819 631 €
VENTAS	73 541	3 610 113 €
VENTURE CORP,	55 000	275 256 €
VEOLIA ENVIRON,	355 719	3 256 607 €
VERBUND	166 566	3 124 778 €
VERISIGN	28 606	842 297 €
VERISK ANALYTICS A	83 161	3 215 046 €
VERIZON CIONS	204 019	6 695 921 €
VERTEX PHARM,	14 915	474 013 €
VESTAS WIND SYST,	151 635	647 513 €
VETROPACK HOLDINGS	1 238	1 729 589 €
VF	4 261	487 927 €
VIACOM CL,B	70 800	2 832 215 €
VICTREX PLC	867 768	17 321 124 €
VIENNA INSUR,GROUP	49 884	2 014 067 €
VINCI	363 698	13 078 580 €
VINDA INTL HLDGS	150 000	155 597 €
VIRBAC	96 964	14 530 055 €
VIRGIN HOLDINGS	211 960	70 103 €
VIRGIN HOLDINGS NV	441 960	- €
VIRGIN MEDIA	21 782	607 167 €
VISA INC LTD	144 543	16 618 498 €
VISCOFAN	239 192	10 239 810 €
VITAL HEALTHCARE	57 517	45 348 €
VITASOY INTL HDGS	154 000	119 358 €
VIVENDI UNIVERSAL	919 144	15 579 491 €
VMWARE A	3 563	254 415 €
VODAFONE GROUP	11 301 238	21 519 865 €
VODONE LTD	596 000	43 160 €
VOESTALPINE	124 152	3 434 044 €
VOLKSWAGEN ORD,	37 243	6 061 298 €
VOLKSWAGEN PF	156 294	26 906 012 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
VOLVO S,B	168 226	1 741 730 €
VOLVO VPC A LIBRE	102 303	1 066 352 €
VORNADO REALTY	41 480	2 519 507 €
VTECH HOLDINGS	37 600	319 567 €
VULCAN MATERIALS	4 587	181 093 €
W,A NL	26 858	94 328 €
WACKER CHEMIE	14 652	727 399 €
WAL MART STORES	317 984	16 456 347 €
WALGREEN	32 656	916 716 €
WALLENSTAM	408 782	3 781 929 €
WANT WANT CHINA	1 335 000	1 395 266 €
WAREHOUS,DISTRIB,	1 773	83 757 €
WAREHOUSE GROUP	30 701	57 441 €
WARTSILA	139 667	4 569 904 €
WASH,REAL ESTATE	12 206	242 102 €
WASHINGTON POST B	440	121 884 €
WASION GROUP HOLDING	94 000	33 392 €
WASTE CONNECTIONS	135 310	3 467 935 €
WASTE MANAGEMENT	81 842	2 094 470 €
WATERS	3 387	223 813 €
WATPAC	33 000	15 462 €
WATSON PHARMACEUT,	113 951	7 433 090 €
WEATHERFORD	28 732	243 865 €
WEIGHT WATCHERS	6 053	240 394 €
WEINGARTEN RTY IN	35 947	729 901 €
WEIR GROUP	159 016	3 683 776 €
WELLING HOLDINGS	220 400	25 451 €
WELLPOINT INC	12 990	600 236 €
WELLS FARGO	884 859	22 940 292 €
WENDEL INVEST,	30 929	2 405 348 €
WERELDHAVE	3 980	191 040 €
WERELDHAVE BELGIUM	1 066	87 945 €
WESFARMERS	232 206	6 766 111 €
WEST CHINA CEMENT	770 000	116 042 €
WESTERN DIGITAL	134 250	4 326 671 €
WESTERN UNION	39 357	406 287 €
WESTF,GRP ST,UNITS	899 515	7 480 021 €
WESTFIELD	1 192 312	2 835 485 €
WESTPAC BANKING	620 525	12 724 207 €
WEYERHAEUSER	17 422	367 627 €
WHARF HOLDINGS	590 544	3 502 106 €
WHEELLOCK	162 000	618 278 €
WHIRLPOOL	4 425	341 508 €
WHITBREAD	37 774	1 139 600 €
WHITE ENERGY	45 966	8 325 €
WHITE MOUNTAINS	1 228	479 688 €
WHITEHAVEN COAL LTD	151 615	417 870 €
WHK GR	53 147	41 224 €
WHOLE FOODS MARKET	78 574	5 432 953 €
WIHLBORGS FASTIGH,	30 242	231 836 €
WIHLBORGS SYD	17 981	212 792 €
WILH,WILHELMSSEN	191 893	1 299 826 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
WILLIAM DEMANT	114 991	7 458 001 €
WILLIAM HILL	399 833	1 715 964 €
WILLIAMS COMPANIES	19 283	478 857 €
WILLIS GROUP HDG LLC	34 489	877 136 €
WILMAR INTL	509 000	1 055 610 €
WINDSTREAM	22 004	138 193 €
WING HANG BANK	46 000	364 175 €
WING TAI HOLDINGS	224 840	260 370 €
WINSWAY COKING	371 000	47 198 €
WINTHROP REALTY	9 016	75 566 €
WIRECARD	184 500	3 431 700 €
WISCONSIN ENERGY	87 295	2 439 943 €
WM,MORRIS,SUPERM,	3 714 075	12 042 926 €
WNR CHILCOTT CL A	31 811	290 507 €
WOLSELEY PLC	61 815	2 210 128 €
WOLTERS KLUWER	214 075	3 312 811 €
WOODSIDE PETROLEUM	124 862	3 331 227 €
WOOLWORTHS	247 022	5 705 296 €
WORKSPACE GROUP REIT	24 788	92 294 €
WORLEYPARSONS	48 413	890 564 €
WOTIF,COM HLDGS	20 928	86 850 €
WPP PLC	584 357	6 397 596 €
WPX ENERGY	10 368	117 017 €
WS ATKINS	358 962	3 376 748 €
WYNDHAM WORLDWIDE	157 731	6 365 949 €
WYNN MACAU LTD	316 000	647 851 €
WYNN RESORTS	4 964	423 544 €
XCEL ENERGY	100 520	2 036 475 €
XEROX ORD,	44 214	228 716 €
XILINX	19 583	532 665 €
XINGDA INTL HLDGS	119 000	46 581 €
XINYI GLASS HLDGS	600 000	280 662 €
XL GROUP	12 758	242 503 €
XSTRATA	175 888	2 296 454 €
XTEP INTERNATIONAL	174 500	56 865 €
XYLEM	98 284	2 020 249 €
YAHOO	106 667	1 610 037 €
YAHOO JAPAN	5 937	1 450 919 €
YAMADA DENKI	165 230	4 819 208 €
YAMAHA	19 400	154 519 €
YAMANA GOLD	257 096	3 351 042 €
YAMATO KOGYO	110 500	2 431 000 €
YANCHANG PRETRO INTL	580 000	31 217 €
YANGZIJ,SHIPBUILD,	378 000	225 321 €
YANLORD LAND GROUP	221 715	209 256 €
YARA INTERNATIONAL	22 792	850 522 €
YGM TRADING	24 000	42 886 €
YING LI INTL REAL	211 000	48 476 €
YINGDE GASES GROUP	177 000	136 491 €
YIP'S CHEMICAL	54 000	29 064 €
YOOX	130 596	1 556 704 €
YUANDA CHINA HDG	486 000	43 755 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
YUE YUEN IND,	167 500	424 540 €
YUM BRANDS	57 847	2 913 411 €
ZARDOYA OTIS	162 432	1 754 266 €
ZHONGSHENG GRP HLD	113 000	129 602 €
ZIMMER HOLDINGS	12 327	623 269 €
ZIONS BANCORP,	9 455	153 472 €
ZODIAC	55 441	4 625 443 €
ZURICH FINANC,SCES	85 585	17 261 675 €

OBLIGATIONS

Valeur boursière de la poche	18 212 769 891 €
-------------------------------------	-------------------------

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
HESS CORP 5,6%10-41	10220	9 272 590 €
PEPPER SNAPPL 2%20	2980000	2 238 152 €
3I GROUP 5,625 17	3838	4 406 078 €
A2A SPA 4,5% 19	2200000	2 292 580 €
ABB FINANCE 2,625%19	10989000	11 865 754 €
ABBAY SVC 3,125 14	2900	3 053 166 €
ABBAY SVC 3,375% 15	5480	5 853 174 €
ABBVIE INC 1,75 1117	8306000	6 370 572 €
ABBVIE INC 2,9% 22	8440000	6 541 327 €
ABBVIE INC 4,4% 1142	690000	555 891 €
ABC 3,5% 2021	7400	6 031 662 €
ABERTIS 4,625% 1016	12	639 468 €
ABERTIS 4,75% 19	2200000	2 331 559 €
ABERTIS 4,75%14	20	2 150 817 €
ABERTIS 5,125%0617	16	886 684 €
ABN 6,375% 2021	8286	9 838 330 €
ABN AMR BK 7,125%22	4281000	5 184 323 €
ABN AMRO BK 4,25%17	11970000	10 048 703 €
ABNAMRO NV 4,125% 22	2300000	2 692 725 €
ABNAMRO NV 4,25% 16	8470	9 598 420 €
ABU DHABI 2,5% 18	685000	525 502 €
ABU DHABI 3,625% 23	1160000	906 061 €
ACCOR 2,875% 06/17	2000000	2 100 249 €
ACE HLD 2,60 15	1633	1 299 998 €
ACE INA 6,7% 05/36	4000	4 203 184 €
ACEA 4,50%10-2020	1000	1 063 457 €
ACESM 4,375% 2020	9	942 292 €
ACUITY BANDS 6% 19	1600	1 389 802 €
ADECCO ,4,75% 2018	3671	4 199 794 €
ADOBE SYS 3,25% 15	3515	2 826 697 €
ADOBE SYS 4,75%10-20	6400	5 503 774 €
ADP 2,375% 11/06/19	1400000	1 487 709 €
AEGON NV 3% 07/17	7261000	7 855 404 €
AETNA 1,75% 05/17	550000	423 823 €
AETNA 4,5% 15/05/42	670000	531 032 €
AETNA INC 2,75%22	900000	676 580 €
AG,FSE DEV,TV PERP	4366000	4 234 689 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
AGF 4,625%05-PERP,	2086000	2 140 916 €
AGILENT 5%0720 SR	1420	1 251 528 €
AGILENT TECH 3,2% 22	825000	629 261 €
AGILENT TECH INC	2500	2 137 639 €
AGRIUM 3,15% 22	1055000	798 042 €
AGRIUM 6,125% 01/41	2980	2 764 464 €
AGRIUM IN 7,125 36	2450	2 482 418 €
AGRIUM INC 6,75% 19	3000	2 883 376 €
AIG 6,797% 2017	1144000	1 376 748 €
AIG 5% 26/06/17	1900000	2 186 124 €
AIG 5,6% 18/10/16	5330000	4 652 197 €
AIG 6,40 15/12/20	1722	1 612 139 €
AIG SUN,4,75%13	5421	5 626 975 €
AIR LIQU 2,125% 21	4000000	4 059 743 €
ALABAMA POW 0,55% 15	3675000	2 783 126 €
ALCAN INC 7,25 31	339	362 885 €
ALL 5% 15/08/2014	3000	2 472 578 €
ALLD WA HL 7,5 16	2365	2 158 358 €
ALLE 1,5% 04/09/22	2000000	2 037 467 €
ALLEGHENY 5,95% 2021	4750	4 080 525 €
ALLERGAN 5,75% 16	1485	1 309 990 €
ALLGHNY ENGY 5,75%19	2550000	2 149 296 €
ALLIAND 4,875% 2015	3800	4 133 416 €
ALLIANZ 5,75% 2041	102	11 963 439 €
ALLIANZ FIN,3,50%22	7300000	8 367 400 €
ALLIANZ II TV25 SR	3000	3 473 705 €
ALLIANZ SE 5,625%42	4800000	5 479 048 €
ALLIANZ TV04-PERP,	1948	2 101 867 €
ALLIANZFIN 4,75%0719	155	9 425 804 €
ALLSTATE 5,2% 2042	1600000	1 456 955 €
ALLTEL 7,875 07/32	928	1 089 180 €
ALSTOM 2,875% 2015	600000	629 921 €
ALSTOM 3,625% 18	4000000	4 359 391 €
ALSTOM 3,875%12-2016	100000	110 916 €
ALSTOM 4% 23/09/2014	8500000	9 022 135 €
ALSTOM 4,50% 180320	3500000	4 057 200 €
ALTADIS EMIS,4%15	1000	1 083 230 €
ALTRIA 10,2% 39	6963	9 020 863 €
ALTRIA GROUP INC	4640	3 992 901 €
ALTRIA GRP 9,25% 19	5500	5 932 515 €
AM BK FSB 6%07-2017	6995000	6 477 325 €
AM,MOVIL 5,50%14	4600	3 733 319 €
AMADEUS CAP 4,875%16	2878000	3 214 830 €
AMCOR 4,625% 04/19	2000	2 389 711 €
AMER 5,04999 09/20	1500	1 275 972 €
AMER ELEC 1,65% 17	1100000	836 047 €
AMER EXPRESS1,75%15	1650000	1 277 911 €
AMER EXPRESS2,8%16	2000	1 615 408 €
AMER IGP 8,175% 58	1635	1 604 303 €
AMER INTL 3%12-2015	4000000	3 177 265 €
AMER INTL 3,8%2017	1000000	826 568 €
AMER INTL 4,875% 16	1625000	1 391 592 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
AMER INTL 4,875%2022	1500000	1 299 346 €
AMER INTL 5,45%07-17	10500	9 164 514 €
AMER MOVIL 3,75%17	3623	4 076 783 €
AMER MOVIL 4,75%22	4000	4 852 264 €
AMER TOWER 4,50 18	2431	2 048 990 €
AMER TOWER 4,625% 15	291	237 823 €
AMERADE 7,125%03-33	4000	4 119 184 €
AMERICA MOV 2,375%16	6420	5 081 913 €
AMERICA MOV 3,125%22	7725000	6 040 098 €
AMERICA MOV 4,125%19	4873	5 621 463 €
america movil 3 0721	1900	2 019 198 €
AMERICAN 4 3/8%16	162	8 995 174 €
AMERICAN 7%18 SR	6200	6 019 637 €
AMERICAN INTERNTL GR	7530	6 894 085 €
AMERICAN TOW 4,7%22	1980000	1 662 576 €
AMERIPRIS 7,518 66	2000	1 681 055 €
AMERIQUE 6,50%26	50000	5 784 390 €
AMEX CRE 7,3% 08/13	2949	2 391 594 €
AMGEN 2,125% 19	5930000	6 102 259 €
AMGEN 4,375%11-2018	5070	5 914 895 €
AMGEN 4,85%14 SR	3385	2 770 229 €
AMGEN 5,375%12,2043	2325000	2 080 554 €
AMGEN 5,65% 2042	1014	925 769 €
AMGEN 6,4% 01/02/39	5690	5 634 628 €
AMGEN INC 4,5% 20	3830	3 324 654 €
AMGEN INC 5,15% 1141	3436	2 940 380 €
AMGEN INC 6,375% 37	430000	408 857 €
AMT 5,9% 2021	1765	1 594 116 €
ANADARKO 5,95%16	862	764 087 €
ANADARKO 6,375 17	5667	5 209 488 €
ANGLIAN 6,25%16	1963	2 385 350 €
ANGLO 5,875%170415	5000	5 745 556 €
ANGLO AME 2,75% 19	5000000	5 213 686 €
ANGLO AMER 2,625% 17	1820000	1 419 380 €
ANGLO AMER 4,125% 22	2500000	2 003 593 €
ANGLO ICAP 7,5 14	2000	2 189 853 €
ANGLOGOL 5,125% 22	1125000	893 484 €
ANGLOGOL 5,375 2020	2225	1 756 466 €
ANHEU 1,375% 07/17	2975000	2 287 723 €
ANHEUS 2,5% 07/22	3125000	2 400 321 €
ANHEUS 3,625% 15	7000000	5 688 747 €
ANHEUS 3,75% 07/42	1950000	1 499 373 €
ANHEUS 5,375 20	2800	2 629 551 €
ANHEUSER 2%12-2019	1000000	1 022 101 €
ANHEUSER 1,25%2017	1420000	1 441 029 €
ANHEUSER 2,875%2024	5620000	5 886 250 €
ANHEUSER 7,75%2019	7800	8 093 162 €
ANHEUSER BU 4% 06/21	648	762 593 €
ANZ 5,125%09-19	1930	2 266 510 €
ANZ NATL1,85%12-2015	1415000	1 099 932 €
AOL TIME 7 5/8%31	600	631 517 €
AON 3,50%300915	2025	1 628 907 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
APACHE 3,625%10-2021	4750	3 984 380 €
APACHE CORP 3,25% 22	675000	544 875 €
APACHE CORP 4,25% 44	10000000	7 681 430 €
APACHE CORP 4,75% 42	1920000	1 592 845 €
APPLIE MAT 5,85% 41	2500	2 312 135 €
AREVA 3,875%09/16	350000	373 648 €
AREVA 4,375%11/19	1300000	1 418 783 €
AREVA 4,875% 0924	900000	988 521 €
ARISTOTLE 2,1% 02/15	2150000	1 681 112 €
ARISTOTLE 4,75% 2021	7000	6 083 189 €
ASCIANO 5%11-2018	1285	1 053 013 €
ASF 7,375%09-2019	5000000	6 870 329 €
ASML HOLD,5,75%17	2635	3 154 028 €
ASSI GEN 5,125% 0924	4100	4 430 440 €
ASSICU GEN 7,75%42	11700000	12 459 138 €
ASSO NTH 6,95%2018	4254000	3 932 699 €
ASSOC BANC-5,125%16	3655	3 065 517 €
AT & T INC 4,3% 2042	4058000	3 091 118 €
AT AND T 5,50%18	4905	4 511 473 €
AT AND T 6,125%15	26	1 517 793 €
AT& T INC 6,5 37	1261	1 254 992 €
AT&T INC 1,875%20	3391000	3 419 086 €
AT&T INC 2,625% 2022	6860000	5 197 018 €
AT&T INC 3,55% 32	4373000	4 551 203 €
AT&T INC 4,35% 2045	9674000	7 322 942 €
ATLANTIA 3,375% 17	1000000	1 045 246 €
ATLANTIA 4,375% 20	3531000	3 808 800 €
ATLANTIA 4,375% 25	699	731 682 €
ATLANTIA 4,5%2019	4514000	5 079 712 €
ATLANTIA 5,625%09-16	1000	1 147 739 €
ATMOS 8,50% 03/19	3120	3 236 872 €
ATT 6,55% 0239	13270	13 404 474 €
AUCHAN 3,625% 2018	700000	789 955 €
AUCHAN 6% 04-19	2000000	2 622 535 €
AUST NZ BK 3375 0317	5700	6 507 701 €
AUSTRAL PROP UNI	3000	2 456 981 €
AUTODESK 1,95%2017	2580000	1 949 359 €
AUTOZONE 2,875% 23	1040000	771 341 €
AUTOZONE 6,5%08-2014	1500	1 233 773 €
AVALONBAY 2,85% 23	4615000	3 450 550 €
AVIVA 4,7291%2014	952000	926 623 €
AVIVA TV23	422	4 308 285 €
AVIVA TVPERP,	214	2 143 034 €
AVNET 4,875% 22	10125000	7 846 187 €
AXA 5,777%06-PERP,	2500	2 527 265 €
AXA 8,6 15/12/30	200	191 364 €
AXA SA 5,25%04-40	104	5 618 542 €
AXIS FINANC 5,875%20	1530	1 300 994 €
BAA 4,6%20 EMTN	3300	3 875 854 €
BAA FUNDIN 4,12 16	510	567 866 €
BAA FUNDING 4,375%17	4455000	5 143 252 €
BAA FUNDING 4,6%16	1100	1 182 861 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
BANCO BILBAO 3,5%17	2200000	2 210 861 €
BANCO POP 4% 2013	2600	2 683 818 €
BANCORP 2,2% 2016	6550	5 177 324 €
BANK 5,125%14 EMTN	62	3 351 568 €
BANK AMER 5,3 17	380	326 377 €
BANK AMER,5,75%17	2246	9 914 843 €
BANK AMERICA 5,65%18	940	4 163 256 €
BANK MONTR 2,55% 22	2000000	1 502 819 €
BANK NOV SCOT1,95%17	9750000	7 759 116 €
BANK OF AMER 5,7%22	4575000	4 246 704 €
BANK OF AMER,4%15	20	1 093 867 €
BANK OF AMERICA 7%16	40	2 443 143 €
BARCL LOND 2,5 13	3560	2 733 052 €
BARCL LOND 4,125%16	2847	3 218 474 €
BARCL LOND 6% 2021	6271	7 457 979 €
BARCLAYS 6,75% 0519	2500	2 322 275 €
BARCLAYS 4,875%08-19	1000	1 210 413 €
BARCLAYS 5,25% 05/14	9990	10 930 274 €
BARCLAYS 6,05%1217	11560	9 765 076 €
BARCLAYS 7,625%2022	2580000	1 965 562 €
BARCLAYS BK 5,14%20	2180	1 754 107 €
BARCLAYS BK 6,625%22	400	491 689 €
BARR 5,95000 10/39	2500	2 191 249 €
BARRICK 6,8%2018	10700	10 151 275 €
BARRICK GD 2,9% 2016	1955	1 558 275 €
BARRICK GOLD 5,25%42	2000000	1 668 708 €
BARRICK NOR 5,70% 41	2135	1 845 281 €
BASF SE 2% 12/22	4210000	4 211 826 €
BAT HLD 2,375% 23	5190000	5 201 548 €
BAT INT FIN 8,5% 18	570	602 283 €
BAT INTL 5 3/8%17	4400	5 399 915 €
BAT INTL 5,875%15	1655	1 913 504 €
BATSLN 4,0875%02-21	3753	4 704 524 €
BAYER 5% 05-15	600000	647 160 €
BAYER,HYPO,6%14	3050	3 335 798 €
BB AND T 5,2% 2015	5070	4 283 692 €
BB&T 1,6% 15/08/17	8050000	6 216 660 €
BB&T 2,05%28/04/2014	4000	3 100 541 €
BBVA 4,25% 03/15	79	4 212 172 €
BBVA SENIO 4,875 14	14	750 308 €
BBVA US 4,664% 2015	1395000	1 093 158 €
BBVAS 4,875% 2016	7	755 454 €
BBVASM 3,625%12-2014	2400000	2 445 375 €
BBVASM 4,375%12-2015	11200000	11 612 671 €
BCO BILB,V,3,25%16	10	1 040 384 €
BCO SANTAND,3,5%14	30	3 129 073 €
BELGELEC 5,125%15	6000000	6 737 698 €
BEMIS CO 6,8% 0819	3570	3 327 243 €
BERKSH HATH 4,4%42	2610000	2 028 944 €
BERTELSMANN 2,625%22	7000000	7 128 081 €
BFCM	1559000	1 647 997 €
BFCM 2,875% 2017	11500000	12 438 597 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
BFCM 3% 29/10/15	5000000	5 306 534 €
BFCM 3,25% 08/22	3800000	4 117 002 €
BFCM 4% 22/10/20	6000000	6 311 278 €
BFCM 4,25% 050214	1500	1 615 251 €
BFCM 4,75% 2049	6584	6 212 791 €
BG ENERGY 3,625%19	1095	1 248 302 €
BG ENERGY 3% 2018	650	707 855 €
BG ENERGY 6,5% 11/72	1250000	1 406 379 €
BHP FIN 2,125% 2018	1910000	1 992 905 €
BHP FINANC 5,25 15	3500	2 999 054 €
BILFNGR 2,375% 19	1384000	1 437 591 €
BK AME,4%18 EMTN	79	3 822 510 €
BK AMERICA 5,875%42	1930000	1 859 352 €
BK CANADA 2,625% 15	2215	1 768 363 €
BK IRELAND 3,125%15	1440000	1 467 782 €
BK MONTREAL 1,95% 17	2705000	2 152 350 €
BK NEDER GT 1,875%19	3000000	3 157 501 €
BKAMERICA 4,5 15	1258	5 134 551 €
BKAMERICA 4,625% 17	252	14 418 644 €
BKAMERICA 5,625% 16	992	4 293 575 €
BKAMERICA 6,5% 16	1377	6 170 885 €
BKAMERICA 7,375 14	2253	9 330 009 €
BKAMERICA 7,625 19	860	4 175 441 €
BLACKST HLD 5,875%21	7000	6 056 020 €
BLOCK 5,125%14	3000	2 419 754 €
BMC SOFTWARE 4,25%22	1750000	1 359 409 €
BMW 3,875% 01/2017	5000	5 742 989 €
BMW US 1,25% 07/16	1580000	1 606 755 €
BNP 2,875% 2017	18526000	19 848 074 €
BNP 3% 0217	9590000	10 497 019 €
BNP 3,25%10-2015	1870	1 492 399 €
BNP PAR,5,019% 17	3000000	2 937 290 €
BNP PAR,5,431%17	2000	2 317 513 €
BNP PARI 2,375% 17	8305000	6 428 482 €
BNP PARI 2,5% 08/19	8515000	8 920 979 €
BNP PARIB 2,625 16	5233000	5 545 938 €
BNP PARIB 3,5 %16	1974000	2 177 450 €
BNP PARIBAS	8694000	9 106 019 €
BNP PARIBAS 3,6% 16	2000	1 623 726 €
BNP PARIBAS 8,667%13	1000000	1 047 667 €
BNP PARIBAS TV08-18	12	688 051 €
BNP TV311249 PERP,	5700000	5 569 472 €
BNZ INTL 4 03/17	1587	1 808 412 €
BOA 4,75%03/04/2017	220	12 768 666 €
BOA 5,625% 2020	6410	28 668 238 €
BOARDW PIP 3,375 23	7000000	5 188 198 €
BOEING 3,75 11/16	4150	3 482 498 €
BOEING 4,875% 02/20	4600	4 240 321 €
BOEING 5,875 %40	225	232 242 €
BORD GAIS 3,62% 17	5680000	5 999 607 €
BOSTON PP 3,85% 23	4090000	3 294 964 €
BOSTON PROP 3,7% 18	1100	908 848 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
BOTTLING 5,125% 0119	4600	4 201 579 €
BOUYGUES 3,641% 2019	400000	438 465 €
BOUYGUES 4% 02/2018	5000000	5 771 439 €
BOUYGUES 4,5% 22	200000	234 747 €
BP 3,561% 2021	5800	4 776 385 €
BP CAPITAL 2,177%16	5000000	5 295 012 €
BP CAPITAL 2,5% 22	4800000	3 613 718 €
BP CAPITAL 3,2%16	8065	6 579 756 €
BPCE 1,75% 03/16	8400000	8 604 959 €
BPCE 2,875% 09/15	1200000	1 268 402 €
BPCE 3,75 07/17	10250000	11 467 880 €
BPCE 4,25% 02/2023	5200000	6 078 456 €
BPCE SFH 4% 03/22	3000000	3 598 656 €
BQUE PSA 4 07/13	3000	3 092 042 €
BQUE PSA 4,875 15	2500000	2 651 999 €
BRAMBLES 4,625% 18	9115	10 818 944 €
BRANDYWINE 6% 0416	4600000	3 957 765 €
BRE Finan 2,75% 15	9000000	9 066 859 €
BRITAM TOB 3,625% 21	1000	1 119 812 €
BRITISH 4,375%14	800	859 060 €
BRITISH TEL 2%2015	2575000	2 002 474 €
BRITISH TEL TV 13	2325000	1 776 071 €
BRITISH TEL 6,125%14	1000	1 108 492 €
BRK 4,95% 2041	4000	3 438 190 €
BRK 5,75%01/04/2018	5800	5 343 726 €
BROADCOM 2,70% 11/18	7675	6 234 919 €
BROWN-FORMAN 2,25%23	6565000	4 891 458 €
BT TEL,6,5%070715	1939	2 264 874 €
BUND 3,25% 07/21	500000	595 472 €
BUNDERSREPUB DEUTSCH	600000	846 099 €
BURL 4,70000 10/19	3565	3 151 909 €
BURLINGTON 4,4% 42	8115000	6 502 108 €
BURLINGTON 4375 0942	1500000	1 207 088 €
BUSINESS 5,75% 2020	1960	1 757 255 €
C AGRICOLE 7,875%19	400000	424 857 €
CA INC 5,375%09-2019	7100	6 165 740 €
CA LONDON 1,875%2017	4600000	4 675 196 €
CADES 2,50% 10/22	4400000	4 589 697 €
CADES 3,625%250415	39200000	43 156 692 €
CADES 3,625%250416	72900000	82 282 669 €
CADES 4,125%17EMTN	6200000	7 287 204 €
CAH 1,9%12-2017	465000	359 159 €
CAIXA 5,125 04/16	30	1 625 000 €
CAJA DE MADRID 3,5%	23	1 119 739 €
CAMDEN PROP 2,95%22	3400000	2 520 736 €
CAMERON 3,6%12-2022	2225000	1 767 781 €
CAN NATL 5,7% 05/17	4620	4 147 376 €
CAN NATL 5,9% 02/18	4545	4 230 135 €
CAN NATL 6,25% 38	1100	1 076 858 €
CANADIAN NATL 6,2%36	605	623 031 €
CAPITAL 6,15%16 SR	8500	7 513 658 €
CAPITAL FIN 2,15% 15	1350000	1 050 389 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
CAPITAL ONE 2,125%14	1700	1 325 051 €
CAPITAL ONE 8,8%2019	940	988 334 €
CAPITAL ONE FI 1%15	2825000	2 135 980 €
CAREFUSION 6,375%19	924	841 211 €
CARGILL 4,307% 05/21	2576	2 160 491 €
CARLB 6% 28/05/14	2000	2 219 038 €
CARLSB BR 3,375% 17	1000	1 097 045 €
CARLSBERG 2,625% 22	5230000	5 249 173 €
CAROLINA P 6,3 38	1760	1 794 422 €
CARREF,4,375%06-16	3100000	3 442 182 €
CARREFOUR 1,875% 17	2703000	2 707 303 €
CARREFOUR 2,875%15	1950000	2 043 338 €
CARREFOUR 5,25% 2018	2000000	2 364 772 €
CASINO 3,157%2019	6300000	6 655 063 €
CASINO 4,481 18	4700000	5 338 150 €
CASINO 4,726% 21	2400000	2 807 673 €
CASINO 5,50%30/01/15	2150000	2 446 749 €
CASINO GU 4,379%17	3100000	3 539 371 €
CATERPIL 3,803% 2042	2924000	2 206 404 €
CATERPILLAR 1,10%15	1310000	1 003 177 €
CATERPILLAR 1,375%14	2655	2 039 864 €
CATERPILLAR 2,85%22	7900000	6 132 761 €
CB AUS 4,25 04/18	9000	10 605 219 €
CBAAU 4,375% 02-20	1700	2 057 585 €
CBS 5,90% 151040	3000	2 665 975 €
CBS CORP 4,3%02/2021	5500	4 647 228 €
CBS CORPO 4,85%2042	1805000	1 416 802 €
CC HOLDINGS 3,849%23	755000	582 696 €
CEFELEC 4,875%2021	1255	1 082 414 €
CEL ARAUCO 7,25 19	1085	1 005 843 €
CELGENE 3,25% 08/22	6280000	4 880 386 €
CELLCO 5,55%09-2014	5380	4 378 014 €
CELLCO PART/VERI	6512	6 842 043 €
CENOVUS 6,75% 2039	1625	1 663 329 €
CENTERP EN 6,5% 18	1345	1 252 975 €
CEZ AS 4,5% 06/20	2993	3 569 845 €
CEZ AS 4,875% 04/25	3989	4 965 574 €
CEZCO 5,75%05-15	1110	1 276 700 €
CFSC 7,15 02/19	5200	5 241 638 €
CH,SCHWAP 0,85%2015	2825000	2 142 430 €
CHEVRON 4,95 19	3000	2 740 088 €
CHEVRON CORP 2,35%22	2025000	1 539 619 €
CHURCH DWI 2,875% 22	3000000	2 293 431 €
CIE FIN,5,375%04-14	5900000	6 464 016 €
CISCO SYS 4,45% 20	4800	4 296 955 €
CISCO SYS 5,5% 40	5650	5 472 535 €
CISCO SYSTEM 5,9% 39	1560000	1 563 432 €
CITIGROUP 3,5%2015	2000	2 151 091 €
CITIGROUP 3,625% 17	500	468 809 €
CITIGROUP 3,953% 16	5000	4 083 686 €
CITIGROUP 4 3/8%18	3497000	3 998 195 €
CITIGROUP 4% 11/15	3000	3 257 202 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
CITIGROUP 4,45% 2017	16690000	14 275 853 €
CITIGROUP 4,5% 2022	9390	8 091 895 €
CITIGROUP 4,75 15	12978	10 647 566 €
CITIGROUP 5%04-2014	7700	6 229 378 €
CITIGROUP 5%19EMTN	2901	3 458 668 €
CITIGROUP 5,375% 20	1045	948 727 €
CITIGROUP 5,5% 1014	6900	5 675 436 €
CITIGROUP 5,875%2042	1500000	1 421 942 €
CITIGROUP 6 1/8%36	2175	1 838 089 €
CITIGROUP 6,125 18	1670	1 524 517 €
CITIGROUP 6,40%13	2328	2 474 156 €
CITIGROUP 6,625 32	1625	1 415 572 €
CITIGROUP 6,875%2038	7800	7 894 398 €
CITIGROUP 7,375%0614	1300	1 474 493 €
CITIGROUP 8,125% 39	194	224 885 €
CITIGROUP TV16EMTN	2000	1 948 712 €
CITIGROUP TV17 S,B	400	369 534 €
CITIGROUP7,375%04/19	13700	18 307 867 €
CITIGRP 4,75%19MTN	2929	2 953 305 €
CITIGRP INC 6,375%14	6800	5 697 093 €
CITY NATIONAL	1900	1 627 532 €
CLIFFS NA 3,95% 2018	1205000	919 813 €
CLIFFS NAT 4,80% 20	335	256 273 €
CLIFFS NAT 5,9% 2020	370000	303 994 €
CLOVERIE 6,625% 42	3426000	4 229 734 €
CME GRP 4,4% 03/2018	2635	2 297 675 €
CNA FIN 7,35% 1119	2865	2 737 253 €
CNA FIN CP 5,75% 21	3000	2 711 790 €
CNP ASS,4,75%PERP,	11900000	10 023 867 €
CNP ASSUR 8,875 2041	1200000	1 254 579 €
CNQCN 3,45% 2021	1400000	1 135 457 €
COCA COLA HBC FIN	1400	1 589 368 €
COCA-COLA 2% 2019	2200000	2 234 526 €
CODELCO 7,5 01/19	488	489 665 €
COM BK 5,5% 08-19	63	3 785 586 €
COM BK AUSTRALIA	500	565 477 €
COMCAST 5,85%15 SR	4000	3 471 033 €
COMCAST 5,90%16	3600	3 183 242 €
COMCAST 6,50%35 SR	3818	3 704 848 €
COMCAST 7,05% 03/33	3000	3 036 558 €
COMCAST CORP	6870	6 414 747 €
COMCAST CORP 5,7%19	2355	2 170 864 €
COMCAST CORP 6,55%39	3609	3 554 870 €
COMERICA BK 5,75%16	6450000	5 685 814 €
COMMONLTH ED 1,95%16	7600	5 975 964 €
COMMONW,5,875%2020	5500	4 521 849 €
COMPASS GRP 3,125%19	3800000	4 225 694 €
CON EDISON NY	9500	8 306 365 €
CONAGRA 2,1%15/03/18	3016000	2 311 836 €
CONOCO FND 7,25 31	5200	5 868 576 €
CONOCOPHI,5 5/8%16	6110	5 458 374 €
CONOCOPHIL 5,2 18	3350	3 017 840 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
CONOCOPHIL 6,5%2039	4000	4 338 698 €
CONOCOPHIL 6,95 29	1160	1 236 065 €
CONT AIRLN 7,25% 21	605	451 979 €
CONTL AIRL 9%16	1345	1 035 689 €
CO-OPERATIVE BNK	7600000	7 645 935 €
CORIO NV 4,625% 18	3100	3 578 874 €
CORN PROD,3,2%10-15	2500	1 990 841 €
COSTCO COMP 1,7% 19	5777000	4 388 421 €
COV BLDG STE 2,25%17	2060000	2 102 871 €
COVENTRY 5,45%11-21	4225	3 795 470 €
COVIDIEN FI 6,55%37	2100	2 235 859 €
COVIDIEN I 4,20 20	328	282 362 €
COVIDIEN I 6% 10/17	4039	3 747 584 €
COX 3,375%09-2039	2975	3 573 959 €
COX 5,45%04-2014	2433	2 018 808 €
COX COMMUN 4,7% 22	4865000	3 806 241 €
CR AGRICOLE 3,875%19	9000000	10 318 725 €
CR,AGR,4,13 11/2015	1850000	1 696 684 €
CR,AGRIC,5,971%18	20	1 187 632 €
CR,SUISSE 6 3/8%13	3400	3 596 631 €
CRDT SUISS 1,625%15	1890000	1 469 218 €
CRED AGRI 3,9% 21	4650000	4 815 265 €
CRED AGRIC 3% 17	5000000	3 900 372 €
CRED,AGRIC,8,2% 2018	200000	228 202 €
CRED,LOG,TV0617	8850000	8 228 035 €
CRED,LOGEMT PERP,	6200000	3 409 836 €
CREDIT 5,875%06-19	150	8 800 789 €
CREDIT LOG 5,454%21	5600000	6 495 173 €
CREDIT SUISSE LONDON	3995	4 822 088 €
CRH 7,375% 05/14	3500	3 968 454 €
CRH AMERIC 5,30% 13	1750	1 384 882 €
CRH AMERIC 6 09/16	3500	3 025 245 €
CRH FINANC 5%12-2019	7200000	8 653 976 €
CROWN 5,495%10-2017	3650	3 182 289 €
CROWN CST 6,113 20	800	740 507 €
CS 3,875%01-2017	2900	3 322 027 €
CS NY 5,3 08/19	2095	1 912 638 €
CSFB 5,50% 08/2013	9000	7 160 994 €
CSX CORP 6,15% 2037	370	355 418 €
CSX CORP 6,25 18	3000	2 801 700 €
CSX CORP 6,25% 2015	1880	1 614 393 €
CVS CARE 5,75% 2041	2670	2 517 496 €
CVS CAREM 6,125 %39	5305	5 159 922 €
CVS CARRK 2,75% 22	8400000	6 396 422 €
CYTEC 6%05-2015	810	684 623 €
CYTEC INDU 8,95% 17	4000	3 788 276 €
DAIGR 2,25% 2019	8300000	6 393 358 €
DAIMLER 1,75%12-2020	10000000	9 976 138 €
DAIMLER 2,625% 2019	8000000	8 629 130 €
DAIMLER AG 2,375% 22	5027000	5 092 441 €
DAIMLER BZ 2% 17	1416000	1 487 423 €
DAIMLER INT 6,125%15	10	578 631 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
DAIMLER NA 8,5% 2031	2100	2 512 409 €
DAIMLERCH,6,50%13	2920	2 343 901 €
DANAHER 3,9% 2021	1450	1 233 921 €
DANSKE 4,75% 04/14	8829	9 548 116 €
DANSKE BANK 2,5% 15	1000000	1 046 590 €
DANSKE BANK 3,875%16	1322000	1 468 060 €
DANSKE BK 3,875% 16	2520	2 034 008 €
DANSKEB 3,875% 2017	2900000	3 276 266 €
DARDEN 2,20% 2017	3600	3 220 956 €
DCP 4,95%12-2042	1660000	1 352 927 €
DCP MIDST 5,35% 20	1355	1 139 148 €
DEERE 3,9% 2042	5460000	4 198 859 €
DEERE 5,375% 2029	1390	1 339 800 €
DEERE CCJ 5,35% 2018	2175	1 990 303 €
DELTA AIRL 4,95% 19	2000	1 438 298 €
DELTA LLOYD 9% 42	5000000	5 682 808 €
DELTALL 4,125% 2017	4200	4 542 002 €
DEU TELEKO 4,25% 22	2734000	3 252 029 €
DEU,BANK 5 1/8%13	2200	2 305 730 €
DEU,TEL,6 5/8%0318	80	104 797 €
DEU,TELEK,8,25%30	2870	3 259 004 €
DEUT BK 5,125%2017	40	2 393 644 €
DEUTSCH B F 2% 23	2330000	2 319 676 €
DEUTSCH POST 2,95%22	1470000	1 569 913 €
DEUTSCHE 2,375%2022	4500000	4 628 706 €
DEUTSCHE BK 6%17	1800	1 661 491 €
DEUTSCHE TEL 2% 19	1150000	1 177 377 €
DEUTSCHE TEL 2,75%24	1610000	1 635 880 €
DEUTSCHE TEL 6%01-17	6124	7 615 115 €
DEUTSCHE TVPERP,	977	796 866 €
DEXIA 5,375% 07/14	2700	2 824 423 €
DIAGEOFIN 5,3% 2015	2500	2 143 747 €
DIAMOND 5,7% 2039	1565	1 522 502 €
DIGITAL 5,25%11-21	700	595 730 €
DIGITAL 5 7/8%20	4900	4 331 314 €
DIREC HLDG 3,125%16	1300	1 043 674 €
DIRECTTV 3,55% 0315	4700	3 787 944 €
DIRECTV 2,4% 03/17	5850000	4 575 711 €
DIRECTV 3,5%11-2016	2500	2 031 095 €
DIRECTV 3,8% 03/22	4500000	3 541 687 €
DIRECTV 4,6%150221	3440	2 886 717 €
DIRECTV 5,15%12-1503	2270000	1 747 702 €
DIRECTV 6,375%11-41	1746	1 550 636 €
DISC FIN 3,85% 2022	1629000	1 265 982 €
DISCOV FIN SVS 1122	3815000	2 975 690 €
DISCOVER BK 8,7%19	1691	1 679 273 €
DISCOVERY 5,625%19	4600	4 237 620 €
DISCOVERY4,95%12-42	3000000	2 398 720 €
DNB BANK 4,75%2022	6050000	6 831 971 €
DNB NORBK 4,375% 21	7435	8 995 262 €
DOMINION 2,25%2015	6110	4 827 278 €
DOMINION RES 4,05%42	350000	263 036 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
DOMINION RES 5,2%19	7255	6 621 166 €
DOMINIONRE 1,80 14	2140	1 652 640 €
DOMINIRES 6 11/17	2565	2 339 000 €
DONG 6,5%09-2019	200	262 065 €
DONG DNK 4 12/16	450	501 791 €
DONG EN 4,875%12-21	1763	2 109 901 €
DOW 1,875%12-2042	2500000	1 873 533 €
DOW CHEMI 7,375% 29	3900	3 910 904 €
DOW CHEMIC 4,125%21	2452	2 040 837 €
DOW CHEMIC 7,6% 14	1012	843 938 €
DOW CHEMICAL 8,55%19	6150	6 349 779 €
DOW CHEMICAL 9,4%39	850	1 056 997 €
DR P 6,82000 05/18	5837	5 600 248 €
DRPEP 3,2% 11/2021	2360	1 846 606 €
DT 3,125% 2016	2920	2 343 829 €
DTSCH POS 1,875% 17	4100000	4 272 914 €
DUKE 7,375% 15/02/15	7000	6 055 529 €
DUKE ENERGY 3,05%22	4000000	3 096 182 €
DUKE ENERGY 4,2%42	2130000	1 650 422 €
DUKE ENERGY 5,05% 19	2040	1 818 856 €
DUKE ENERGY CAR	4700	4 075 209 €
DUKE REALT 5,40% 14	3000	2 461 142 €
E,ETAT 3,75%05 OAT	1106405692	1 316 020 767 €
E,ETAT 4,25%03OAT	792189567	966 990 427 €
E,ETAT 6%94 OAT	8450000	12 011 263 €
E,ETAT 8,50%92 OAT	1078864356	1 791 584 466 €
E,L,M,TV-PERP,	47	2 419 328 €
E,ON INTL 6 3/8%17	2280	2 876 915 €
E,ON INTL FN 5,25%15	877	994 161 €
EADS FINA 4,625 16	2000	2 290 667 €
EANDIS 2,75% 22	1900000	1 960 870 €
EANDIS 4,50%2021EMTN	12	1 423 173 €
EASTMAN CHEMI 2,4%17	1358000	1 067 931 €
EASTMAN CHEMI 3,6%22	5132000	4 137 441 €
EASTMAN CHEMI 4,8%42	2400000	1 977 992 €
EATON CORP 5,6 18	2550	2 295 159 €
EBAY 4%12-2042	750000	554 728 €
ECOLAB 1% 08/15	1025000	780 177 €
ECOLAB INC 5,5% 41	3950	3 585 746 €
EDENRED 3,625% 2017	13300000	14 511 342 €
EDF 2,75% 2023	7100000	7 268 339 €
EDF 3,875% 18/01/22	1900000	2 204 509 €
EDF 4,6%10-27/01/20	4700	4 096 711 €
EDF 4,625 04/30	400000	476 323 €
EDF 4,625% 11/09/24	2000000	2 380 304 €
EDF 6,50%19	1590	1 508 532 €
ELIA SYS,4,75%14	3000	3 249 937 €
ELISA CORP 2,25% 19	1000000	1 022 331 €
ELM 5,849%07-2017	7750000	7 774 845 €
EMBARQ 7,995%36 SR	8130	6 786 914 €
ENAGAS FIN 4,25%17	7900000	8 366 384 €
ENEL 3,5% 26/02/16	2700	2 841 188 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
ENEL 4,125% 2017	1270	1 365 581 €
ENEL 5,25%200617	8335	9 412 961 €
ENEL FI 4% 09-16	6000	6 391 884 €
ENEL FIN 3,625%2018	1830000	1 908 973 €
ENEL FIN 5,75% 2018	11418	13 061 078 €
ENEL FIN 4,625% 2015	2004	2 178 873 €
ENEL FIN 4,875% 20	2470000	2 693 682 €
ENEL FINA 3,875% 14	560	441 121 €
ENERG BAD W 7,375%72	1400	1 641 289 €
ENEXIS 1,875% 2020	6170000	6 193 454 €
ENI 4 5/8%13 EMTN	1000	1 044 311 €
ENI 4% 29/06/20215	270	291 393 €
ENI 4,25%12-03/02/20	3300000	3 877 587 €
ENI SPA 4,125%09-19	238	13 564 471 €
ENSCO PLC 3,25% 16	10860	8 832 237 €
ENSCO PLC 4,70% 2021	1115	965 621 €
ENTER PRODU 5,20% 20	6350	5 793 299 €
ENTERGY M 3,1% 2023	1690000	1 266 488 €
ENTERPRISE 5,25%2020	2780	2 539 804 €
ENTERPRISE 6,125%39	5845	5 375 285 €
ENTR PRODU 6,45% 10	4500	4 302 434 €
EOG RESOUR 2,625% 23	1400000	1 074 033 €
EOG RESOURCES 2,5%16	2055	1 643 244 €
EON INTL F 5,8 18	2770	2 571 959 €
ERAC USA FINANCE	4390	3 360 159 €
ERP OPERAT 4,625%21	3200000	2 721 726 €
ESB FIN LTD4,375% 19	2280000	2 418 724 €
ESB FINANCE 6,25% 17	3106000	3 620 639 €
ESE PRODT 3,20% 16	935	760 709 €
ESE PRODT 6,65 34	400	383 141 €
ETP 5,2% 2022	3695000	3 221 858 €
ETP 6,50% 2042	8090000	7 573 115 €
ETP 9% 15/04/2019	1222	1 228 553 €
EUREKO 7,375%09-2014	9261	10 479 887 €
EUREKO TV 05/2049	136	1 350 833 €
EUROGRID 3,875% 2020	25	1 418 158 €
EUTEL 4,15% 03/2017	3700000	4 229 555 €
EUTLSAT SA 5% 19	5900000	7 231 928 €
EVERYTH 3,25%2018	4900000	5 152 606 €
EVI 7%38 SR	1640	1 452 906 €
EXELON 4,25% 06/22	2552000	2 026 372 €
EXELON GEN 5,20% 19	2650	2 304 104 €
EXPNL 4,75%02-20	5729	7 025 970 €
EXPNLN 2,375% 2017	1350000	1 046 591 €
express scr 6,125 41	955	920 685 €
FADE 4%12-2015	6500000	6 546 854 €
FAIRFAX FINL 5,8 21	845	664 755 €
FCE BANK 2,875%2017	1540000	1 602 871 €
FEDEX 2,625% 2018	2910000	2 234 420 €
FGA CAPITA 4%11-2013	2152	2 222 336 €
FHN CORP 5,375 15	5700	4 718 051 €
FIFTH THIR 3,62 %16	4500	3 695 367 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
FIFTH THIR 4,50 18	2500	2 077 679 €
FINMEC FN 4,375% 17	4784000	5 032 653 €
FINMECCAN 8,125 13	920	982 223 €
FIRST NIAG6,75%03/20	6045	5 537 280 €
FISERV 3,50%12-2022	1450000	1 108 666 €
FLORID PWR 6,4% 38	5680	5 738 884 €
FLORIDA PW 5,4 35	415	390 570 €
FLORIDA PW 5,95% 38	790	798 256 €
FLUOR CORP 3,375%21	1500	1 215 563 €
FNMA 0 09/10/19	829	2 754 017 €
FONC REG 3,875% 18	4000000	4 267 480 €
FONC,LYON,4,625%16	1900000	2 088 069 €
FORD CRED 6,625%17	5585000	5 062 465 €
FORD MOT CRED 8,7%14	1200000	1 039 883 €
FORD MOTO 8,125% 20	1400000	1 394 767 €
FORD MOTOR 3%12-2017	9845000	7 684 038 €
FORD MOTOR 5%18	976000	822 024 €
FORD MOTOR 7,45%31	2777000	2 731 580 €
FORD MOTOR 8% 2016	1640000	1 505 633 €
FORDMOTOR4,25%17	3470000	2 862 135 €
FORTIS 5,757%17	14500	16 487 817 €
FORTIS BANK TV21	805	813 934 €
FORTIS BK 4 5/8%PL	496	23 694 246 €
FORTIS BK 4% 02/15	7059	7 763 992 €
FORTIS BK 4,375%17	1000	1 156 003 €
FORTUM 2,25% 09/22	1660000	1 656 360 €
FPL CAPIT 6,35% 66	1500	1 222 384 €
FR TEL 5,375% 2042	2000000	1 781 313 €
FRA,E,ETAT 4%04OAT	415584637	448 509 586 €
FRA,TEL,5 5/8%18	4513	5 591 169 €
FRA,TELEC,8 1/8%33	467000	770 574 €
FRANCE TE 2,125% 15	3000	2 353 728 €
FRANCE TE 3,375 22	1400000	1 523 300 €
FRANCE TELEC 2,5%23	2000000	1 995 902 €
FRANCE TELEC 2,75%16	850	680 169 €
FRCE TEL 3,875%21	4500000	5 203 761 €
FREEPOR-TMC 2,15% 17	3350000	2 565 773 €
FREEPOR-TMC 3,55% 22	6195000	4 713 393 €
FRTEL8,5% 01/03/2031	5400	6 198 006 €
G4S INTL 2,875%2017	6562000	6 896 829 €
G4S PLC 2,625% 18	828000	828 982 €
GAS NAT 4,125 18	69	3 783 952 €
GAS NAT 5,375 19	7	801 103 €
GAS NAT 5,6250 17	39	4 566 577 €
GAS NAT 6,375 19	2000000	2 387 027 €
GAS NATUR 4,125%17	2200000	2 360 490 €
GAS NATURAL 5,125%21	300	327 314 €
GAS NATURAL 6% 20	12200000	14 090 236 €
GAS NATURL 5%2018	2900000	3 314 600 €
GASSM 3,375% 01/2015	10	532 775 €
GATX CORP 4,85% 21	7300	5 895 292 €
GATX CORP 8,75 14	2500	2 102 643 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
GAZPROM 3,755% 03/17	1070000	1 154 012 €
GDF SUEZ 1,625% 17	3650000	2 785 677 €
GDF SUEZ 2,625% 2022	2412000	2 498 765 €
GDF SUEZ 3% 2023	7585000	8 092 489 €
GDF SUEZ 3,125 20	23	2 571 150 €
GE 4,125%35 EMTN	3280	3 333 964 €
GE 4,65% 2021	6000	5 199 420 €
GE CAP 3,75% 04/16	750	835 218 €
GE CAP 5,5%09-2067	3777	3 790 431 €
GE CAP 6,025% 03/38	2496000	3 419 935 €
GE CAP EUR 4,25%17	1500	1 732 949 €
GE CAP FUND 1,25% 15	2918000	2 960 033 €
GE CAP FUND 2% 0215	1177000	1 226 292 €
GE CAP FUND 2,875%19	1660000	1 797 869 €
GE CAPIT 4,125%16	22049	24 597 378 €
GE CAPIT,5,375%18	2000	2 482 095 €
GE CAPITAL 4,35%21	1000	1 172 339 €
GE CAPITAL EUR FUND	254	16 531 040 €
GE EUR FUND 5,375%20	3500	4 457 109 €
GEA GROUP 4,25% 2016	1000	1 108 531 €
GECAP TRUST 4,625%66	5600	5 579 756 €
GECC 2,25 11/15	2023	1 590 055 €
GECC 5,30% 02/2021	7000	6 241 345 €
GECC 5,55% 04/05/20	14080000	12 737 466 €
GECC 5,625 09/17	6680000	6 051 172 €
GECC 5,9 13/05/14	1913	1 564 743 €
GECINA 4,25% 02/16	1500000	1 668 745 €
GECINA 4,5% 09/14	600000	640 759 €
GECINA 4,75% 04/19	6000000	6 833 680 €
GEN ELEC CAP 3,15%22	4500000	3 509 848 €
GEN ELEC CAP 3,35%16	3000	2 454 533 €
GEN ELECTR 4,125%42	2770000	2 163 620 €
GEN ELECTRIC 2,7%22	9550000	7 394 187 €
GENERAL 5,875%38	8095	7 538 979 €
GENERALI 4,875 %14	7000	7 455 226 €
GENERALI TVPERP,	10	442 013 €
GENWORTH 6,515%18	2910	2 385 588 €
GEORGIA CY 4,3% 42	9585000	7 589 987 €
GEORGIA POW 2,85% 22	4720000	3 704 681 €
GILEAD 4,5%11-2021	3660	3 190 743 €
GILEAD SC 3,05%11-16	1340	1 089 965 €
GILEAD SC 5,65%11-41	9270	8 707 072 €
GL ELEC,6,75%32	6937	6 891 000 €
GLAXOSM 1,50% 17	3000000	2 309 807 €
GLENCORE 5,25% 03/17	34	1 977 958 €
GLENCOREF 6% 04/14	3340000	2 710 854 €
GOLDMAN 3,70%10-2015	9335	7 571 411 €
GOLDMAN 4,375%10-17	4	225 818 €
GOLDMAN 4,5%230516	10	556 912 €
GOLDMAN 4,50%17MTN	4000000	4 556 973 €
GOLDMAN 4,75%14	6000	6 496 231 €
GOLDMAN 5,125% 10/19	78	4 544 748 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
GOLDMAN 5,35%16	7100	6 076 118 €
GOLDMAN 5,75%12-2022	10605000	9 689 495 €
GOLDMAN 5375 0320	6695	5 881 659 €
GOLDMAN 6,375%18	6900	8 608 443 €
GOLDMAN 6,75%37	2130	1 842 355 €
GOLDMAN SAC 6,25%41	1685	1 580 049 €
GOLDMAN SACHS 4,5 16	464	517 007 €
GOLDMAN SACHS 6% 20	4000	3 596 561 €
GOODMAN 6,375% 2020	7700	6 525 600 €
GREAT 5,292%2022	1845000	1 598 658 €
GRUPO TV 6,625%2040	1625	1 598 452 €
GSACHS G 3,625% 16	951	772 754 €
GSACHS G 6% 05/14	7675	6 247 697 €
GSACHS G 6,15% 18	1144	1 031 463 €
GUARDI 7,375% 09/39	1078	1 081 154 €
HAMMERSON 2,75%2019	1210000	1 254 279 €
HAMMERSON 4,875%15	2122	2 359 810 €
HANNOVER FI 5%06/49	500	526 228 €
HANNOVER FIN,5%2043	4500000	4 944 845 €
HANNOVER FIN,TV24	6500	7 096 333 €
HARLEY-DAVID 6,8%18	7750	7 214 242 €
HARTFORD 6,625% 0340	8000	7 627 783 €
HARTFORD FI 6% 19	1000000	909 934 €
HCN 4,125% 04/2019	5530000	4 502 799 €
HCP 2,625%12-2020	2275000	1 721 420 €
HCP INC 6,75% 02/41	2500	2 509 571 €
HEALTH CARE 6%17	3000	2 672 254 €
HEALTH SVC 4,70 21	1480	1 351 952 €
HEINEKEN 2,125%2020	7000000	7 132 746 €
HEINEKEN 2,875%2025	1000000	1 025 608 €
HEINEKEN NV 1,4%17	5840000	4 431 103 €
HEINEKEN NV 3,5% 24	2460000	2 754 669 €
HEINEKEN NV 4% 42	1800000	1 327 109 €
HENKEL 5,375% 2104	600	648 810 €
HERA 4,125%16	500	546 957 €
HERA SPA 4,5 % 19	3913	4 177 383 €
HEWLETT 2,625%11-14	1805	1 387 187 €
HEWLETT-PACK 2,6% 17	2800000	2 084 841 €
HEWLETT-PACK 3,30%16	4000	3 095 333 €
HIG 5,125% 2022	1510000	1 325 759 €
HIG 6,625% 2042	1150000	1 106 708 €
HIT FIN BV 5,75 18	42	4 860 819 €
HIT FIN,4,875%1021	14	732 365 €
HJ HEINZ 1,5% 17	2145000	1 652 263 €
HJ HEINZ 2,85% 22	1445000	1 121 319 €
HOLCIM FI,4,375%14	1000	1 066 986 €
HOME DEPOT 5,95%41	1350	1 380 218 €
HONEYWLL 5,7 03/37	985	981 375 €
hospitality 5 0822	3665	2 991 035 €
HSBC 4 7/8%17	36	2 109 654 €
HSBC 4% 30/03/2022	3350000	2 801 190 €
HSBC 4,875% 2022	4735	4 242 217 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
HSBC 6,1% 2042	1050	1 069 381 €
HSBC 6,5%15/09/37	3745	3 571 273 €
HSBC BANK 3,875% 18	5650	6 460 627 €
HSBC BANK 5,13%16	942000	974 314 €
HSBC CAP FD TV-PER	935	969 720 €
HSBC FIN,3,75%15	4500	4 854 722 €
HSBC FINCE 6,676% 21	6250	5 770 110 €
HSBC HDG 6,8%0638	3250	3 167 304 €
HSBC USA 1,625%2018	4325000	3 280 399 €
HSBC USA 5% 27/09/20	6200	5 162 978 €
HSBCBANK 3,125% 17	1000	1 094 401 €
HSBCBANK 3,875 16	1000	1 120 272 €
HSBCBANK 4% 01/21	1000	1 204 768 €
HUMANA INC 3,15% 22	3200000	2 401 675 €
HUMANA INC 7,2% 2018	835000	779 487 €
HUTCHISON 4,75 16	88	5 016 471 €
HWLTT PCKD 4,75% 14	7520	5 948 992 €
HYATT HOTELS 5,75%15	1600	1 357 684 €
HYUNDAI CAP 2,125%17	3175000	2 436 927 €
HYUNDAI SV 4,37% 16	6400	5 318 640 €
HYUNDAI SV 6% 15	4500	3 780 708 €
IBERDR FIN 3,5% 16	102	5 375 292 €
IBERDR SA 3,875% 14	4	424 917 €
IBERDROLA 3,80%2014	545	430 017 €
IBERDROLA 4,125%2020	67	3 711 281 €
IBERDROLA 4,5% 17	2600000	2 864 954 €
IBERDROLAC 7,5%11-15	100	5 797 796 €
IBESM 4,75% 2016	104	11 669 160 €
IBM 5,7% 14/09/17	8700	8 077 965 €
IBM 5,875% 11/32	1150	1 152 331 €
IBM 6,22% 08/2027	2625	2 701 008 €
IBM 6,50 01/28	1285	1 346 866 €
IBM 7,625%1018	8450	8 664 407 €
IMERYS 5%180417	2000000	2 315 547 €
INBEV NV 8,625%01-17	4600	6 366 828 €
ING 3% 01/09/15	720	570 031 €
ING 3,25 03/04/19	5000000	5 535 727 €
ING 4% 15/03/2016	1850	1 507 322 €
ING 4%11-23/12/16	4795000	5 286 608 €
ING BANK 2%12-2015	4375000	3 362 817 €
ING BANK 3,875%11-16	12460	13 871 680 €
ING BANK 3375 0315	1500	1 620 190 €
ING BANK 4,5% 2022	14895000	17 875 614 €
ING BANK NV 3,75% 17	4000000	3 254 604 €
ING BANK TV19	3315	3 401 058 €
ING BANK TV290523	1926	2 169 577 €
ING BK NV 2,375% 14	5535	4 264 390 €
ING GROEP 4 1/8%16	100	111 878 €
ING GROEP 4,75%17	3000	3 520 350 €
ING US 5,5% 07/22	3090000	2 595 105 €
ING US 5,5% 07/22	6000000	5 039 040 €
INGERSOLL 6% 13	5000	3 994 185 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
INLT GAME 7,50% 19	6200	5 577 735 €
INT PAPER 7,5% 21	2500	2 522 240 €
INT PAPER 7,95%08-18	2335	2 289 972 €
INT,LEASE 6,50%14	322	266 072 €
INTEL CORP 2,7% 22	10435000	7 898 315 €
INTESA 3,75%11-16	156	8 081 152 €
INTESA 3,75%12-2019	500000	536 638 €
INTESA 3,875%15	84	4 449 286 €
INTESA 4%10-2018	70	7 198 076 €
INTESA 4,375% 2016	5	550 630 €
INTESA 5% 0217	2100000	2 351 215 €
INTESA SA 4,125% 16	43	4 642 981 €
INTESA SA 4,375%2019	6700000	6 953 253 €
INTESA SAN 4% 17	6694000	6 952 837 €
INTESA SAN PAOLO	156	8 098 164 €
INTESA SANP 4,875%15	7600000	8 206 434 €
INTESA SP 3,625%22	3000000	3 072 953 €
INTESA TV280518	17	807 479 €
INTNED 2,125% 2015	1000000	1 038 803 €
INTP 7,3% 15/11/2039	965	997 525 €
INTPUBLICGRP 3,75 23	2875000	2 181 204 €
IP 9,375%15/05/2019	1430	1 483 040 €
ISPIM 4,125%12-2016	7000000	7 386 277 €
J P MORGAN 5,25%15	9000	7 468 877 €
JEFFERIES8,50% 2019	4000	3 735 900 €
JOHN DEERE 2,25%19	1200000	944 693 €
JP MORGAN 3,875%2020	20	1 148 225 €
JP MORGAN 4 3/8%21	114	6 062 708 €
JP MORGAN 4,375%19	39	1 965 683 €
JP MORGAN 4,5%12-22	13040000	11 380 525 €
JP MORGAN 6%011017	7625	6 916 576 €
JP MORGAN TV 18	36	1 785 183 €
JPM 3,75% 2016	2242	2 499 149 €
JPM 4,625% 2021	9370	8 123 255 €
JPM 7,9% 2018	3955	3 430 760 €
JPM CHASE 6 07/17	9300	8 467 228 €
JPMORG CHASE 4,4%20	8430000	7 285 134 €
JPMORGAN 1,875%2019	7518000	7 551 683 €
JPMORGAN 2,75% 0822	9550000	9 958 554 €
JPMORGAN 3,25% 22	13600000	10 680 165 €
JPMORGAN 5,25%15	14	797 647 €
JPMORGAN 6,125%04-14	49	2 726 852 €
JUNIPER NET 5,95%41	2000	1 766 027 €
K FOODS 6,875% 2039	645	693 162 €
KAISER HOSP 3,5% 22	3050000	2 451 016 €
KBC 5%11-2016 EMTN	64	3 676 205 €
KBC IFIMA 3% 08/16	2505000	2 658 508 €
KBC IFIMA 3,625%14	450000	476 700 €
KBC IFIMA 3,875 15	12711	13 794 738 €
KBC IFIMA 4,37 15	1000	1 087 770 €
KBC IFIMA 4,50% 0914	4500	4 805 453 €
KELLOGG 4,45% 05/16	3000	2 524 817 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
KENT UTILI 5,125%40	2505	2 315 375 €
KEYCORP 3,75% 2015	7000	5 752 262 €
KEYCORP 5,10% 21	2000	1 784 006 €
KEYCORP 6,50%13 SR	1635	1 277 527 €
KFT 5,375%10/02/2020	2466242	4 363 204 €
KINDER 5% 0842	4875000	3 946 825 €
KINDER MORG 3,95%22	2625000	2 142 481 €
KINDER MORG 6,85% 20	3000	2 910 001 €
KINDER MORGA 3,5% 16	7665	6 270 535 €
KINDR MORG 9% 19	620000	649 302 €
KLEPIERRE 4% 10-2017	4200000	4 706 061 €
KLEPIERRE 4,25%16	1500000	1 676 509 €
KMP 5,625%15/02/2015	5700	4 823 723 €
KMP 6,5%01/09/2039	3110	2 928 265 €
KOHL'S 3,25%2023	1720000	1 280 421 €
KOHL'S 6%02-2033	8600	7 581 664 €
KON,KPN 4,75%14	1298	1 401 645 €
KON,PHILIP,5,75%18	1900	1 768 451 €
KONIN,KPN 4,75%17	11000	12 691 391 €
KPN 3,25% 2021	660000	669 948 €
KPN 6,25% 04/02/14	400	445 971 €
KPN 7,50% 04/02/19	2200	2 946 609 €
KRAFT 6,125%18 SR	454	426 545 €
KRAFT 6,25%15	3172	3 687 379 €
KRAFT 6,5%17 SR	2035	1 919 203 €
KRAFT 6,50%31	4500	4 378 916 €
KRAFT 6,875% 39	1856000	1 927 928 €
KRAFT 6,875%38 SR	2035	2 168 113 €
KRAFT FOODS 3,5% 22	810000	654 305 €
KRAFT FOODS 5% 42	9400000	7 928 089 €
KRAFT FOODS 6,875%39	2680000	2 758 391 €
LA POSTE 2,75%2024	8100000	8 279 726 €
LEASEPL C 3,875 15	1523	1 634 207 €
LEASEPL CO 4,125% 15	900000	983 282 €
LEGAL TV25 EMTN	2239	2 254 189 €
LEGRAND 4,25% 02/17	1300000	1 502 966 €
LEGRAND 4,375% 2018	2300000	2 715 220 €
LIBERTY 5%11-2021	1040	865 000 €
LIBERTY MUT 6,5% 42	1450000	1 252 632 €
LIFE TEC 3,50%2016	3123	2 533 317 €
LINCOLN 4,85% 2021	5460	4 594 812 €
LINCOLN 6,05/TV 67	1495	1 141 373 €
LINCOLN 8,75%09-2019	1834	1 857 745 €
LINDE AG 1,75% 20	335000	338 051 €
LINDE FIN 3,875%21	1048	1 238 398 €
LINDE FIN, 6% 2049	400	420 120 €
LINDE FIN,TV140766	7363	8 874 458 €
LLOYD TSB 4,875% 16	7950	6 754 080 €
LLOYD TSB 6,375% 21	4250	4 053 665 €
LLOYD TSB 3,75 15	1900	2 058 186 €
LLOYDS 5 7/8%14	4000	4 345 250 €
LLOYDS 6,375%062016	2291	2 764 541 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
LLOYDS BK 4,625% 17	2800000	3 273 159 €
LLOYDS TSB 6500 0320	7289	8 695 424 €
LLOYDS TV050318	1779	1 792 473 €
LORILLARD 2,3% 0817	4370000	3 389 790 €
LORILLARD 3,5%3,5%16	2800	2 273 648 €
LOTTOMATI5,375%12-16	20	1 101 908 €
LOTTOMATIC 5,37 18	10	580 651 €
LOTTOMATICA 3,5% 20	2900000	2 996 531 €
LOWES COMP 4,65% 42	1090000	915 375 €
LUXOTTICA 3,625% 19	7500000	8 467 655 €
LUXOTTICA 4%2015	3080000	3 329 287 €
LVMH 4 06/04/2018	600000	702 953 €
M&I MARSH 4,85% 0615	7032	5 737 368 €
MACK-CALI REA,2,5%17	1575000	1 205 711 €
MACQUARIE 6,625%2021	2700	2 284 249 €
MACQUARIE BK 3,45%15	13900000	11 115 739 €
MACYS 5,125% 2042	6215000	5 185 023 €
MACYSRETAIL 2,875%23	13718000	10 160 038 €
MAGELL MID 6,4 18	1760	1 671 459 €
MANULIFE 3,4%10-15	8404	6 744 207 €
MARATHON OIL 2,8% 22	7445000	5 686 331 €
MARATHON P 6,50% 41	3885	3 784 187 €
MARSH 5,75% 0915	273	469 761 €
MASS MUTL 8,875% 39	1564	1 777 253 €
MCDONALD1,875%2019	3019000	2 335 152 €
MCDONALD'S 2,375% 24	7800000	7 782 548 €
MCDONALDS 4% 02/21	10	1 199 521 €
MCKESSON 0,95% 15	2900000	2 206 151 €
MCKESSON 7,5%09-2019	190	191 692 €
MDC HLDGS 5,625% 20	6500	5 464 143 €
MEDIOBANCA 3,75%15	2398000	2 466 511 €
MEDIOBCA 4,625% 16	5000000	5 307 303 €
MEDTRONIC 2,625%2016	2000	1 608 477 €
MERCIALYS 4,125% 19	5600000	6 329 982 €
MERCK FIN 4,5%10-20	2247	2 733 162 €
MERCK NEW 2,40% 22	300000	228 943 €
MERCK&CO 5%09-2019	7100	6 438 929 €
MERR LYNCH 5,7% 2017	1480	1 238 654 €
MERRILL 4 5/8%13	3921	4 061 376 €
MERRILL 4 7/8%14	20	1 080 430 €
MERRILL 6,75%13	72	3 828 868 €
MERRILL 7,75%38	1683	1 657 870 €
MERRILL L,4 5/8%18	500	533 146 €
MET LIFE 1,7% 2015	8000000	6 181 044 €
MET LIFE 2,375% 19	5174000	5 436 794 €
METLIFE 4,125 0842	6420000	4 932 435 €
METLIFE 6,50 12/32	3153	3 095 844 €
METLIFE 6,75%16 SR	1875	1 691 109 €
METLIFEINC6,4% 1236	6450	5 211 603 €
METRO AG 3,375% 2019	6276000	6 858 299 €
METRO FIN 2,25% 18	1849000	1 892 783 €
MICHEL LU 8,625 14	969	1 128 281 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
MICROSFT CO 2,125 22	3605000	2 706 497 €
MIDAM NRJ 5,8%06-36	2055	1 998 519 €
MIDAMER 6,5 09/37	5170	5 175 531 €
MIDAMER,6 1/8%36	8238	7 910 410 €
MISS POW 4,25% 03/42	1025000	802 995 €
MIZUHO BK 2,95%2022	3499000	2 635 502 €
MONDI 5,75% 2017	2897000	3 438 100 €
MONDI FINAN 3,375%20	1260000	1 306 058 €
MONSANTO 2,20%2022	1475000	1 115 739 €
MONSANTO5,875% 04/38	5000	5 047 605 €
MORG 4,50% 02/2016	5822	6 481 589 €
MORG 5,375% 08/20	104	6 011 758 €
MORG 5,75% 01/21	537	473 564 €
MORGAN 5,5%2021	3000	2 631 902 €
MORGAN 5,50%021017	1200	1 380 164 €
MORGAN 6,375%12-2042	2500000	2 278 450 €
MORGAN C&C 3,45% 16	6110	4 979 240 €
MORGAN C&C 3,7 15	2220	1 800 004 €
MORGAN C&C 4,35 21	1340	1 149 160 €
MORGAN C&C 6,3% 19	2	1 887 €
MORGAN C&C 6,4% 38	3680	3 745 514 €
MORGAN INC 4,2 14	5000	3 973 579 €
MORGAN ST 4,5%10/14	23	1 222 393 €
MORGAN ST,4 3/8%16	5131	5 594 116 €
MORGAN STAN 5,95% 17	3500000	3 011 932 €
MORGAN STAN 6%04-14	8116	6 563 039 €
MORGAN STAN 7,3%19	5248	4 869 175 €
MORGAN STAN,6,5%18	18	1 075 747 €
MORGAN STAN,LIBUS 15	775000	567 639 €
MORGAN STANL 3,75%17	7454000	8 013 927 €
MORGAN STANL,5%19	3950000	4 517 592 €
MOSAIC 3,75%15/12/21	2200	1 777 862 €
MOSAIC 4,875% 41	645	529 554 €
MOTABILITY 3,75 17	400	445 211 €
MOTOROLA 3,75%22	2575000	2 002 606 €
MOTOROLA 6% 11/17	2500	2 246 239 €
MOVIL SAB 5,625 17	2645	2 415 742 €
MOVIL SAB 6,375 35	1020	1 030 894 €
MS 3,8% 2016	1800	1 439 100 €
MS 5,5%26/01/2020	10685	9 233 958 €
MTVD 5,75%15/01/2020	6900	6 447 413 €
MUNC,RUCK,TV PERP,	210	11 412 114 €
MUNCHENER 6,75%23	1000	1 064 522 €
MUNICH RE 6% 2041	5	615 539 €
MUNICH RE 6,25% 42	4300000	5 405 656 €
MURPHY OIL 3,7% 22	1700000	1 282 536 €
MURRAY 4,647%2017	6000000	4 904 353 €
MYLAN INC 6% 11/18	4125000	3 481 460 €
NAB 4,625%10-20	3000	3 494 443 €
NABISCO 7,55 06/15	576	505 824 €
NABORS INDUSTRIES 6,	6400	5 835 271 €
NASDAQ OMX 5,25% 18	6900	5 870 077 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
NAT AUS BK 2,75%2022	900000	948 020 €
NAT AUS BK 4 20	4900	5 730 933 €
NAT RURAL 5,45 17	6250	5 586 206 €
NATGRID US 3,25 15	3310	3 558 395 €
NATIONAL 5%18 EMTN	1700	2 060 994 €
NATIONWIDE 3,125%17	7037000	7 744 079 €
NATIONWIDE 3,75%2015	7573	8 277 445 €
NATIONWIDE 5,375%21	7550	6 247 254 €
NATIXIS 4 3/8%0718	2000000	1 958 375 €
NATIXIS TV0519EMTN	5600000	5 498 263 €
NATL 3,8% 10/22	1425000	1 109 420 €
NATL BANK CA 2,20%16	5690000	4 544 936 €
NATL OILWELL 2,60%22	8885000	6 786 928 €
NATWIDE BS FRN 20	8177	9 804 784 €
NBC UNIVER 2,87% 16	3000	2 413 237 €
NBC UNIVER 4,37% 21	1655	1 424 917 €
NBC UNIVER 5,95% 41	1600	1 493 569 €
NBCUNIVSAL 4,45%43	2919000	2 235 726 €
NBHSS 4,5%03-20	1877	2 133 274 €
NBL 8,25% 03-19	6100	6 180 912 €
NCB CLEVE 5,25%2016	3340000	2 890 531 €
NCB CLEVE 5,8 17	5000000	4 470 646 €
NEM 6,25%01/10/2039	1165	1 050 211 €
NETAPP INC 2% 17	1325000	1 001 772 €
NEW YORK 4,3/8%17	119	6 939 526 €
NEW YORK LIFE	1353	1 398 245 €
NEWMONT 4,875% 03/42	1285000	1 011 616 €
NEWMONT 5 7/8%35	2300	2 010 960 €
NEWMONT MIN 3,5% 22	8100000	6 372 712 €
NEWS 6,15%37 SR	7000	6 555 823 €
NEWS AMER 6,15 41	3340	3 243 544 €
NEWS AMER 6,2%04-34	995	917 003 €
NEWS AMER 6,65%2037	2270	2 228 525 €
NEWS AMER 6,9%09-19	4130	4 019 122 €
NEXEN 5,875%05-35	1700	1 581 867 €
NEXEN 7,5%09-2039	860	957 946 €
NEXEN INC 6,4% 37	1000	966 460 €
NEXTERA 1,20%2015	1925000	1 467 039 €
NEXTERA ENERGY	3619000	2 775 894 €
NGGLN 4,375%05-20	888000	1 067 633 €
NIAGARA 3,553%09-14	2170	1 737 430 €
NIF 6,125%01/03/2022	3560	3 281 003 €
NISOURCE 6,40%18	990	919 676 €
NOBLE ENERGY 4,15%21	4425	3 655 828 €
NOBLE ENERGY 6% 2041	3040	2 812 922 €
NOBLE HOL 4,9% 2020	3000	2 600 504 €
NOMURA 5,125 12/14	2000	2 131 381 €
NOMURA HLDS 5% 2015	3000	2 444 023 €
NORDDEUT 0,875% 15	4400000	3 349 012 €
NORDEA AB 2,125% 14	2300	1 785 997 €
NORDEA AB 3,625% 16	3688	4 115 352 €
NORDEA BANK 4% 07/19	6854000	7 951 032 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
NORDEA BANK 4,25%22	3010000	2 356 174 €
NORDEA BANK AG	1380	1 448 811 €
NORDEA BK 3,25% 22	4190000	4 606 589 €
NORDEA BK 3750 0217	1900	2 162 969 €
NORDEA BK 4,5%09-14	2300	2 492 669 €
NORDEA BK 4,625% 22	900000	1 009 487 €
NORDSTROM 7%07-2038	1810	1 971 136 €
NORFOLK 2,903% 02/23	1284000	987 597 €
NORFOLK 7,25% 01-31	3283	3 496 537 €
NORTHERN 2,375%2022	2900000	2 187 731 €
NORTHGROUP 6,378%49	430	332 655 €
NSANY 4,50%01-15	5500	4 538 877 €
NSC 5,9% 15/06/2019	1280	1 182 247 €
NSTAR ELEC 2,375%22	3725000	2 825 060 €
OAT 3% 25/04/22	638855461	712 845 600 €
OAT 3,5%AVRIL 2015	396404525	436 895 727 €
OAT 3,50% 25/04/20	2625479335	3 075 476 422 €
OAT ZCP 04/24	8800000	6 704 280 €
OAT3,25%06-16	371222619	415 805 133 €
OAT3,75%07-17	452017074	525 567 434 €
OAT4%08-18	761724614	908 132 363 €
OAT4,25%07-23	1094405862	1 325 453 679 €
OCC PETRL 4,10% 21	1550	1 356 444 €
OHIO 6,60%01032033	2200000	2 224 063 €
OHIO E 6,875% 07/36	2105	2 132 485 €
OMAHA 6,95% 2040	7000	6 771 594 €
OMNICOM 3,625% 05/22	2975000	2 364 754 €
OMNICOM 4,45% 2020	6029	5 127 357 €
OMNICOM 5,9%16 SR	1000	873 329 €
OMV AG 4,25% 10/21	3000	3 559 142 €
ONCOR 5,3% 06/42	4480000	3 894 815 €
ONCOR ELEC 4,1% 06/2	2200000	1 821 422 €
ONCOR ELEC 7% 09/22	45000	43 992 €
ONEOK 8,625% 03/19	2000	2 044 977 €
ONEOK INC 6% 06/2035	4300	3 676 646 €
ONEOK PART 3,375% 22	4660000	3 627 852 €
ONEOK PART 6,65%36	750	713 427 €
ONEOK PARTN 2% 17	1050000	810 466 €
ONEOK PARTN 6,85%37	1800000	1 754 429 €
OPER 1,25% 08/15	2750000	2 109 340 €
ORACLE 5,375% 2040	2229000	2 132 618 €
ORACLE 5,75 04/18	2920	2 722 989 €
ORACLE CORP 2,5% 22	8865000	6 780 956 €
ORIG ENER 2,875%19	3700000	3 863 855 €
OWENS CORN 4,2% 22	1180000	913 802 €
OXY 1,75% 2017	10220	7 997 374 €
PAC LIFE 9,25%39	1567	1 666 639 €
PAC,GAS 6,25%39 SR	3000	3 028 226 €
PACCAR FIN 1,375% 15	580000	592 958 €
PACKAGING 3,90%2022	1560000	1 223 315 €
PASO NATGAS 5,95% 17	3790	3 339 613 €
PASO NATL 8,625% 22	875	940 910 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
PEG 3,65%12-2042	1165000	873 957 €
PEMEX 6 3/8%16REGS	2135	2 527 942 €
PENSK TRUCK 2,5%14	1500000	1 159 582 €
PENSKE TR 3,375% 18	11750000	9 072 506 €
PENSKE TRUC 3,125%15	2650000	2 059 741 €
PENSKE TRUCK 3,75%17	2500000	1 984 320 €
PENTAIR FCE 5% 2021	1360000	1 187 836 €
PEOPLE'S UNT 3,65%22	7829000	5 964 677 €
PERKINELMR 5%21	1750	1 476 915 €
PERNOD RI 4,875 16	5000000	5 748 400 €
PERNOD RIC 7% 15	700000	830 134 €
PETRO MEX 4,875 0122	5405000	4 702 918 €
PETROHAWK 7,875%15	2524	2 006 715 €
PFIZER 5,75%03/06/21	25	1 673 487 €
PFIZER 7,20% 03/39	7050	8 272 307 €
PFIZER INC	2700	2 287 993 €
PHILIP 2,125%2019	3710000	3 881 439 €
PHILIP IN 6,375%2038	2340000	2 409 646 €
PHILIP INT 1,12% 17	3000000	2 277 229 €
PHILIP MORRIS	4000	3 325 953 €
PHILLIPS 2,95% 17	1513000	1 220 398 €
PHILLIPS 66 4,3%2022	6250000	5 311 023 €
PIONEER NAT,3,95%22	825000	670 324 €
PKO FINAN 3,733% 15	1000000	1 059 561 €
PL 7,375%15/10/2019	6400	5 992 592 €
PLAINS 2,85%12-2023	4610000	3 459 843 €
PLAINS 5,75% 2020	4110	3 828 320 €
PLAINS PIPEL 3,65%22	5600000	4 482 446 €
PLAINS PIPEL 5,15%42	1285000	1 093 781 €
PLUM CREE 4,70% 21	1760	1 464 803 €
PNC FINANC 8,729% 22	1700000	1 298 536 €
PNC FUNDING 6,7%19	2750	2 655 107 €
PNC PFD TV 06-2049	55	3 383 634 €
POHJOLA BA 3 17	3000	3 274 556 €
POHJOLA BK 5,75% 22	2271000	2 774 570 €
POST HOMES 3,75% 22	7750000	5 883 532 €
PPG INDS 3,60% 20	2000	1 631 978 €
PPL CAPITAL 3,5%22	4112000	3 185 710 €
PPL ELEC 3% 2021	1050	848 198 €
PPL ENERGY 6,5% 2018	2500	2 281 771 €
PPR 3,125% 23/04/19	5285000	5 827 229 €
PPR 3,75% 04/2015	4347000	4 732 546 €
PRECIS CAST 3,9% 43	2050000	1 583 800 €
PRICOA GLO 5,45 14	2125	1 726 082 €
PRIDE INT 6,875% 20	4400000	4 286 713 €
PRINCIPALFI 3,125%23	4225000	3 190 531 €
PRINCL FINL 4,625%42	1350000	1 050 208 €
PROCTER 4 7/8%27	6970	9 132 426 €
Procter&G 2% 0822	1100	1 110 215 €
PROG EN 3,15% 04/22	2665000	2 057 567 €
PROG ENER 3%11-2021	3000	2 386 082 €
PROGRE 6,7% 2037	1500	1 222 432 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
PROGRS NR 4,875% 19	1965	1 711 995 €
PROLOGIS 7,625% 11-1	3800	3 231 876 €
PROTC LIFE 8,45% 39	1250	1 255 995 €
PRU 3,875%14/01/2015	2250	1 834 625 €
PRU FI4,75%17/09/15	7415	6 237 610 €
PRUD 4,50% 2021	2500	2 131 732 €
PRUDENT 7,575% 2019	1825	1 764 456 €
PRUDENT 8,875% 68	2920	2 694 940 €
PRUDENT FI 4,5% 2020	4000	3 394 918 €
PRUDENT FI 5,7% 36	696	591 640 €
PRUDENTIAL 6,625%40	1150000	1 101 199 €
PS COLOR 2,25%2022	1725000	1 311 090 €
PS COLOR 3,20% 20	1690	1 387 489 €
PUBLIC SERV 4,75% 41	4405	3 914 484 €
PX 4,5%15/08/2019	4700	4 151 269 €
QUEST DIAG 4,7% 21	1670	1 418 552 €
QVC 7,5% 01/10/19	2175000	1 852 850 €
QVC INC 7,375%2020	800000	684 123 €
QWEST CORP 6,5% 2017	3010	2 676 188 €
QWEST CORP 7,5 %14	1061	897 299 €
RABOBANK 3,375% 17	5000000	5 572 131 €
RABOBANK 3,5% 10/18	5020	5 604 204 €
RABOBANK 3,75% 2020	1000	1 073 233 €
RABOBANK 3,875% 16	1125	1 261 492 €
RABOBANK 3,95% 22	7835000	6 120 230 €
RABOBANK 4% 01/22	3445000	4 077 622 €
RABOBANK 4,125% 2021	2827	3 362 514 €
RABOBANK 4,125% 25	2850	3 381 538 €
RABOBANK 4,125%2020	6200	7 366 052 €
RABOBANK 4,2%09-14	3920	3 128 953 €
RABOBANK 4,375%09-16	4871	5 553 069 €
RABOBANK 4,75%0118	12500	15 134 405 €
RABOBANK NL 3,875%22	7795000	6 454 083 €
RABOBANK TF11%/TV 49	1160	1 187 946 €
RABOBK 5 7/8% 05/19	5150	6 388 727 €
RAIFFEISEN TV0319	482000	463 126 €
RB SCOTLD 4,875 14	3340	2 711 821 €
RB SCOTLD 6,4 19	3500	3 159 790 €
RBS 2,55%12-2015	2255000	1 761 083 €
RBS 4,375% 2016	7000	5 818 139 €
RBS 4,75% 1016	2252	2 570 031 €
RBS 5,5%10-23/03/20	3500	4 370 473 €
RBS 5,625%10-2020	2890000	2 587 700 €
RBS CIT 4,15% 22	3650000	2 445 912 €
RBS GRP PLC 5,375%19	6760	8 158 759 €
RCI 4 11/07/13	2561000	2 648 169 €
RCI 4 16/03/16	3500000	3 834 842 €
RCI 4,25% 27/04/17	400000	443 201 €
RCI 5,625 10/15	3637000	4 049 923 €
RCI BANQ 2,125% 2014	1290000	1 309 818 €
RCI BANQUE 3,75% 14	250000	262 626 €
REALTY INC 3,25%2022	3400000	2 535 747 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
REALTY INCOME	7000	6 313 874 €
REALTY INCOME 2%2018	3600000	2 730 055 €
RED ELEC 3,50% 10/16	34	1 783 749 €
RED ELECT 4,75% 18	102	11 518 548 €
RED ELECTR,4,75%13	1400	1 451 821 €
RELIANCE 5,4% 0222	3340000	2 848 399 €
REPSOL 4,25% 16	33	3 662 903 €
REPSOL 5%13 SR	90	936 243 €
REPSOL INT,4,75%17	800	905 952 €
REPU SVCS 5,25% 21	740	664 275 €
REPUBLIC 5,5%19	1550	1 411 768 €
REPUBLIC 5,70%11-41	1500	1 353 753 €
REPUBLIC SV 6,2%40	3450	3 332 357 €
REYNOLDS 7,625%06/16	4210	3 826 168 €
REYNOLDS AME 3,25%22	3715000	2 840 684 €
RIO 7,125%0728 SR	1430	1 503 743 €
RIO TINTO 2,875%24	2829000	2 895 228 €
RIO TINTO 1,125%2015	3775000	2 892 296 €
RIO TINTO 1625 0817	3850000	2 967 465 €
RIO TINTO 2% 20	7210000	7 339 961 €
RIO TINTO 2875 0822	1375000	1 058 295 €
RIO TINTO 3,5%12-22	1530000	1 234 104 €
RIO TINTO 3,5%20	7000	5 674 002 €
RIO TNNT0 9% 2019	4840	5 114 232 €
ROCHE 6,5% 03-21	920	1 306 651 €
ROCHE HD 6% 01/03/19	5685	5 458 704 €
ROCHE HLDG 7%09-39	2925	3 370 820 €
ROPER IND 3,125% 22	10472000	8 105 972 €
ROPER INDS 6,25 19	5000	4 643 864 €
ROWAN COS 5,4% 42	1330000	1 001 999 €
ROWAN COS INC	3725000	3 069 364 €
ROYAL BK 4,35%17	20	1 065 552 €
ROYAL BK 5,25%13	2500	2 618 894 €
ROYAL BK 5,75%05-14	8670	9 540 276 €
ROYAL BK 6%13	2775	2 921 902 €
ROYAL BK SC 6,934%18	5000	5 895 263 €
ROYAL BK SCOTLND	4100	4 569 106 €
RTE 3,875 06/22	300000	341 859 €
RTE EDF 2,125%2019	6100000	6 290 755 €
RUBY PIPEL 4,5% 17	2275000	1 881 353 €
RWE 4,625% 20	10600	10 922 217 €
RWE 5% 10-15	500	566 363 €
RWE 6,5%08-21	3950	5 427 292 €
RYDER SYS 3,15% 2015	7000	5 532 795 €
RYDER SYS 7,2% 15	2500	2 203 751 €
SABMILLER 1,85%2015	3300000	2 574 858 €
SABMILLER 1,875% 20	4700000	4 709 004 €
SAFEWAY 7,25 02/31	3000	2 548 231 €
SAGESS 4%12-2024	1300000	1 555 702 €
SAMBILLER 4,5% 01/15	3543	3 958 745 €
SAMPO OYJ 4,25% 17	3325000	3 771 978 €
SAMSNG 1,75% 2017	4100000	3 146 070 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
SAN DIEGO 4,3%2042	2500000	2 096 781 €
SAN DIEGO 4,5%0840	670	572 948 €
SANDVK 6,875%02-14	1350	1 524 288 €
SANPAOLO IMI TV20	115	5 045 417 €
SANPAOLO TV18 SUB,	15	667 435 €
SANT INTL 3,50% 14	218	11 167 095 €
SANT,ISSUAN,TV1017	80	3 400 152 €
SANTAND INT 4,375%14	7000000	7 263 993 €
SANTANDER 3% 2015	1475000	1 149 047 €
SANTANDER 3,381% 15	25	2 524 349 €
SANTANDER 3,875%2022	2275000	1 792 157 €
SANTANDER 4%27/03/17	3200000	3 389 516 €
SANTANDER 4,125%22	1625000	1 256 407 €
SANTANDER 4,625% 16	4100000	4 333 802 €
SANTDEBT 4,125 17	2300000	2 403 494 €
SANTDEBT 4,50 15	50	5 302 647 €
SAPRR 4,375 01/16	70	7 900 630 €
SAPRR 4,875% 01/19	3000000	3 553 337 €
SCANA 4,125% 12-22	1650000	1 319 263 €
SCHLMB NOR 4,20% 21	2303	1 995 240 €
SCHNEID ELEC 2,95%22	5850000	4 472 732 €
SCOR 6,154%06PERP,	4450000	4 667 589 €
SCOTTISH & SOUTH	10646	11 148 904 €
SCOTTISH 6,125%2013	2300	2 434 024 €
SD CHARTERED 5,75%14	600	663 214 €
SEB 3,75% 2016	1921	2 136 978 €
SEB AB 4,25 02/18	5594	6 573 097 €
SECURIT AB 2,25% 18	1000000	1 011 714 €
SECURIT AB 2,75% 17	1000000	1 057 947 €
SEMICDT 3,95% 15	3000	2 458 271 €
SEMPRA 9,8% 15/02/19	815	887 474 €
SEMPRA ENERGY 6%39	7100	6 822 638 €
SES 4,75%11-2021	600	731 713 €
SEGLX 4,625%03-20	12540	15 108 323 €
SEGLX4,875%07-14	200	216 564 €
SEVERN 5,25%110316	2148	2 522 411 €
SG 3,125 21/09/17	41	2 219 801 €
SG 4,25% 2022	1200000	1 384 004 €
SHBASS 1,50% 2015	900000	923 202 €
SHBASS 2,875% 2017	7000000	5 631 897 €
SHBASS 3,125% 2016	7400	6 042 532 €
SHELL 6,375%12-38	1160	1 244 373 €
SHELL INT 4,375 20	3050	2 711 667 €
SHELL INTF 5,5% 40	2370	2 339 072 €
SIEMENS F 6,125% 26	945	946 741 €
SIEMENS TV140966	3600	4 052 051 €
SIMON PROP 5,65%20	3025	2 787 576 €
SIMON PROP 1,50%2018	1675000	1 262 168 €
SIMON PROP 2,75%2023	2050000	1 545 630 €
SIMON PROP 4,75%42	3000000	2 448 700 €
SK TELECOM 2,125% 18	2500000	1 912 088 €
SKAND ENSK 4% 09/22	2630000	2 813 793 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
SKAND,ENS,TV PERP,	750	839 459 €
SKANDI ENSK 3,875%17	300000	344 418 €
SKANDINAV 1,875%2019	10924000	11 025 810 €
SKANDINAV 2,5%2015	1700	1 788 369 €
SKF AB 1,875% 19	2220000	2 249 232 €
SLM CORP 4,625% 17	5000000	3 908 635 €
SLM CORP 5% 10/13	1900	1 494 617 €
SLM CORP 6% 25/01/17	1735000	1 457 287 €
SLM CORP 6,25 16	4810	4 062 356 €
SMITHS GR 4,125% 17	3000	3 358 126 €
SNAM 3,50% 2020	6545000	6 864 544 €
SNAM 3,875% 18	6110000	6 606 449 €
SNAM 5,25% 22	3500000	4 051 556 €
SNAM SPA 5% 01/19	6870000	7 931 741 €
SNAP ON 4,25% 2018	2400	2 053 164 €
SNCF 4,375% 15/04/26	500000	606 617 €
SNS BANK 2,125% 17	740000	761 848 €
SNS BANK 3625 0713	2570	2 628 528 €
SOC GE 3,75% 0317	12000000	13 478 719 €
SOC GEN 2,375% 02/18	6300000	6 572 135 €
SOC GEN 2,75% 17	6975000	5 385 224 €
SOC GENERALE 3%10-15	39	2 077 591 €
SOC NATL 3,25%2024	2900000	3 370 368 €
SOCGEN 3,75%08-14	120	6 363 676 €
SOCGEN 4% 2016	1100000	1 229 133 €
SOCGEN 5,2% 2021	1500	1 267 356 €
SODEXO 6,25%01-15	3344	3 904 522 €
SONOCO 4,375%11-2021	800	651 824 €
SOUTH POWE 4,87% 15	5730	4 857 789 €
SOUTHE COPP 5,25% 42	5725000	4 365 124 €
SOUTHERN 2,375%10-15	8970	7 123 686 €
SOUTHERN 4,5% 09/40	1535	1 304 244 €
SOUTHERN 6,75%042040	2640	2 423 548 €
SOUTHERN CAL ED	2065	1 995 414 €
SOUTHW AIR 5,75% 16	2000	1 708 487 €
SOUTHWEST 6,45% 0119	4000000	3 732 855 €
SPAREBANK1 SR 2% 18	1920000	1 956 469 €
SPAREBANK3,625%03/15	2000	2 161 728 €
SPAREBK RG 3,5% 17	4000000	4 437 908 €
SPAREBK RG 3,50% 16	1900	2 080 803 €
SPECTRA EC 5,65% 20	2650	2 381 069 €
SSELN 5,625%12-2049	1040000	1 118 716 €
ST CHART 3,625% 15	16600	17 927 939 €
ST GOBAIN 3,625%2021	7968000	8 415 889 €
STAND CHART 1,75%17	4234000	4 325 761 €
STANDARD 5,875%17	20	1 181 286 €
STANDARD C 3,625% 22	4200000	4 310 843 €
STANLEY 5,20%40 SR	2600	2 293 787 €
STANLEY BLACK 2,9%22	1350000	1 036 033 €
STAPLES 9,75%09-2014	2700	2 312 942 €
STATKRAFT 2,5% 22	4814000	4 871 451 €
STATOIL 3,125% 2017	3900	3 236 646 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
STATOIL AS 4,25%2041	2500000	2 034 702 €
STATSTREET 4,95% 18	3315	2 853 419 €
STE FONCIERE 3,50%17	600000	621 461 €
STEELRIVTC 4,71 17	500	331 674 €
STGOBAIN 3,50 15	6197	6 620 909 €
STGOBAIN 3,625 %22	5270000	5 586 763 €
STGOBAIN 4% 10/18	650	717 765 €
STGOBAIN 4,50 19	1774	2 001 206 €
STRYKER 2%11-2016	3000	2 375 839 €
SUEZ 4,078% 2021	300000	351 255 €
SUEZ EN 4,82%10-49	5600000	5 776 040 €
SUEZ ENV 6,25% 04/19	2700000	3 540 791 €
SUNCOR 6,85% 2039	1540	1 605 715 €
SUNCOR ENG 5,95 34	6900	6 394 768 €
SUNCOR ENG 6,1 18	5140	4 798 289 €
SUNTRUST 3,50% 2017	7500	6 179 049 €
SUNTRUST BK 3,6% 16	8000	6 493 932 €
SVB FINANC, 5,375%20	7000	6 022 656 €
SVENSKA 3,375% 2017	5000000	5 572 358 €
SVENSKA 3,75% 02/17	8100	9 238 897 €
SVENSKA 4,194% 12/49	500	504 842 €
SVENSKA HAND 2,25%18	6970000	7 386 913 €
SVK HANDBK 2,62%2022	5000000	5 200 885 €
SWE MATCH 3,875% 17	3700	4 149 523 €
SWEDBANK 1,75% 15	1800000	1 854 682 €
SWEDBANK 3,375%2017	7315000	8 170 545 €
SWEDBANK AB 3% 22	5772000	5 846 838 €
SWEDBK HYPO 2,375%17	1565000	1 250 043 €
SWISS 7%19/05/2014	1200	1 354 944 €
SWISS TRES 2,875%22	4730000	3 592 117 €
SWISS TRES 4,25% 42	2040000	1 519 409 €
SYMANTEC 2,75% 17	4254000	3 320 248 €
TALANX 8,3673% 42	400000	504 626 €
TAMPA ELECTR 4,1%42	1000000	782 588 €
TARGET 4% 01/07/2042	7900000	6 078 118 €
T-BOND 2,75% 11/42	12815000	9 371 269 €
TCM SUB 3,55% 2015	755	609 861 €
TDC AS 3,50% 02/2015	1855	2 013 489 €
TDCDC4,375% 2018	3000	3 517 660 €
TEACHERS INS6,85%39	773	1 587 763 €
TECK RES 2% 2042	780000	609 858 €
TECK RES 3% 0319	1850000	1 447 937 €
TECK RES, 3,75%2023	3175000	2 488 484 €
TECK RESOU 6 %40	1040	892 753 €
TEL,IT,5,25%13 S,B	3291	2 581 493 €
TEL,ITA,4,75%14	22	1 183 019 €
TEL,ITA,7,75%33	1456	1 783 535 €
TEL,MEXICO 5,5%15	1950	1 645 085 €
TELECOM 5,25% 2055	20	1 729 628 €
TELECOM 7,721%08-38	2880	2 376 970 €
TELECOM IT 4,625%15	3896000	4 257 325 €
TELECOM IT 6,125% 18	9755000	11 181 317 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
TELECOM IT 8,25%0316	5700	7 111 616 €
TELECOM ITALIA 4%20	9051000	9 189 300 €
TELECOM ITALIA 7%17	3441	4 223 173 €
TELECOM ITL 4,5%2017	3540000	3 823 088 €
TELECOM ITL4,75%18	500	552 050 €
TELEF SAU 3,661 17	162	8 526 810 €
TELEF SAU 7,045% 36	1829	1 504 999 €
TELEF,EM,4,375%16	6775	7 484 027 €
TELEFO 5,496%04-16	8	455 484 €
TELEFO MOV 2,875% 15	909	703 870 €
TELEFONICA 5,811%17	4300000	4 947 214 €
TELEFONICA 4,6911/09	90	4 930 979 €
TELEFONICA 4,71%20	6000000	6 570 234 €
TELEFONICA 4,75% 17	10	1 126 717 €
TELEFONICA 4,797%18	1100000	1 247 245 €
TELEFONICA 4,967%16	55	6 186 393 €
TELEFONICA 5,431% 02	49	2 671 206 €
TELEFONICA6,221%17	2645	2 226 047 €
TELENOR 4,125%10-20	7000	8 314 361 €
TELIASONER 3,875% 25	588	675 415 €
TELIASONERA 3% 0927	650000	673 336 €
TELIASONERA 3,625%24	3890000	4 429 151 €
TELSTRA 3,625%10-21	2000	2 315 076 €
TELSTRA 3,75% 2022	1900	2 193 110 €
TELSTRA 4,25% 2020	1000	1 203 718 €
TERNA 4,75% 03/21	8200	9 648 041 €
TERNA SPA 2,875% 18	3954000	4 113 521 €
TESCO 5,125%47	500	620 540 €
TESCO 5,5 %15/11/17	480	429 337 €
TESLTRA CO 3,50% 22	9255000	10 327 826 €
TEVA PFIN 6,15 36	5125	5 160 676 €
TEVA PHA FIN 2,25%20	3000000	2 289 707 €
TEVA PHA FIN 3,65%21	1450000	1 178 120 €
THERMO FISH 3,2%2016	9500	7 697 085 €
THOMSON RE 4,7% 2019	425	369 820 €
THYSSEN 8% 0614	2635	2 986 260 €
TIME WAR, 6 5/8%29	1355	1 302 263 €
TIME WARN 6,75%2018	4130	3 911 165 €
TIME WARNER 4,9% 42	1760000	1 425 856 €
TIME WARNER 6,10% 40	7750	7 257 079 €
TIME WARNER 6,55%37	9920	9 331 094 €
TIME WARNER INC	5250	4 937 653 €
TIME WARNER7,57%24	1012	1 043 251 €
TIME WARNR 3,15% 15	2840	2 309 089 €
T-NOTE 0,75 12/17	2835000	2 153 200 €
T-NOTE 1,25% 10/19	1870000	1 432 207 €
T-NOTE 1,625%2022	9781000	7 345 655 €
TOBACC FIN 4,50 18	4460	5 194 792 €
TOBACCO 6,875%2020	5450000	5 053 946 €
TOBACCO 8,375% 02/16	3499	4 503 394 €
TOBACCO FIN 5%2019	4000000	4 772 830 €
TORONTO BK 1,50%2017	10235000	7 975 715 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
TOTAL CAP 1,625%14	870	672 885 €
TOTAL CAP 2,3% 2016	1125	894 150 €
TOTAL CAPITAL1,55%17	3200	2 464 122 €
TOTALCAPI 2,125% 23	3500000	3 529 322 €
TOYOTA 2%11-15/09/16	1500	1 181 461 €
TRANS 5,05% 15/12/16	8420	7 104 089 €
TRANS 6,375% 151221	4250	3 901 060 €
TRANSALTA 4,5% 22	3200000	2 450 813 €
TRANSCANA 6,35% 2067	1500	1 214 328 €
TRANSCANAD 7,25% 38	1500	1 652 723 €
TRANS-CANADA 2,50%22	3000000	2 286 193 €
TRANS-CANADA 3,8% 20	6200	5 268 809 €
TRANSOCEA 4,95% 15	2025000	1 686 349 €
TRANSOCEA 6% 03/18	1955	1 751 176 €
TRANSOCEAN 3,8% 22	1025000	802 302 €
TRAVEL COS 5,9% 2019	2250	2 122 319 €
TURLOCK 2,75%2022	8250000	6 239 946 €
TURLOCK 4,15%12-2042	875000	669 452 €
TVO 4,625%04/ 02/19	1419000	1 665 574 €
TVO 6%09-27/06/16	500000	587 444 €
TWARN CABL 5 2020	4500	4 033 821 €
TWARN CABL 5,87 40	2000	1 758 414 €
TWARN CABL 7,5% 2014	8945	7 473 356 €
TWAT UTIL 3,25% 2016	4666	5 070 898 €
TXN 1,375% 5014	3500	2 692 116 €
TXN 2,375%2016	4335	3 452 916 €
TYC 2,25% 2017	3863000	2 914 735 €
TYC 3,50% 2022	1000000	753 438 €
TYCO ELEC 3,5% 02/22	1550000	1 224 423 €
TYCO FLOW 1,875%2017	2937000	2 239 459 €
TYCOELECT 7,125% 37	2300	2 301 860 €
TYSON FOODS 4,5%22	5573000	4 567 396 €
UBI SPCA 3,875% 2013	2000	2 072 834 €
UBI SPCA 4,939% 2014	2000	2 112 992 €
UBS 2,25%12-30/03/17	1010000	801 033 €
UBS 6%18 EMTN	6000	7 661 065 €
UBS AG 3,125%2016	8000000	8 763 877 €
UBS JERS,TV18 EMTN	2002	2 027 354 €
UBS STAM 2,25% 14	6365	4 940 648 €
UBS STAM 3,875% 15	4500	3 660 179 €
UBS STAM 5,875 16	3550	3 090 767 €
UDR 4,25%11-2018	8000	6 661 382 €
ULFP 2,25% 2018	9147000	9 516 689 €
UNI DI BANC 3,75%15	6000000	6 150 725 €
UNIBAIL 3,375% 03/15	1500	1 619 876 €
UNIBAIL 3,875%10-20	3905	4 462 594 €
UNIBAIL ROD 3,875%17	2522	2 814 264 €
UNIBAIL-ROD 1,625%17	3600000	3 646 454 €
UNICRDT BK 3,25% 14	1500000	1 565 556 €
UNICREDIT 4,375% 15	5060000	5 397 473 €
UNICREDIT 3,375% 18	7090000	7 168 083 €
UNICREDIT 3,625% 13	800	821 853 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
UNICREDIT 4,25% 2018	280	311 189 €
UNICREDIT 4,375%20	200	2 145 543 €
UNICREDIT 4,875% 17	13100000	14 555 399 €
UNICREDIT 4,875%13	1000	1 047 825 €
UNICREDIT 5,75%17	400	431 589 €
UNICREDIT 6,95% 22	14700000	15 479 787 €
UNICREDIT TV15 MTN	360	3 465 136 €
UNICREDITO 5,25 14	3739	4 069 810 €
UNION BK 3% 2016	7400	5 950 889 €
UNION PAC 4,163%2022	2005	1 745 027 €
UNION PAC 6,125 20	2080	2 000 169 €
UNITED PARC 2,45% 22	1850000	1 412 227 €
UNITED UT,4,25%20	1100	1 305 246 €
UNITEDH 3,95% 42	1075000	804 318 €
UNITEDHEALTH 6,5% 37	2480	2 462 281 €
UNITEDTECH 3,10 2022	3400000	2 731 222 €
UNITEDTECH 4,50 2042	2735000	2 282 648 €
US AIRWAY 2,5% 10/22	1125000	932 871 €
US TREAS 2% 15/02/22	1800000	1 421 053 €
US TREASURY 3%12-42	3529000	2 728 390 €
US TREASURY 2,75% 42	4580000	3 378 871 €
USA 0,25% 08/15	9700000	7 351 280 €
USA 0,625% 30/11/17	4560000	3 448 116 €
USA 0,625% 17	1935000	1 467 011 €
USA 0,75% 10/17	3500000	2 665 982 €
USA 5,5%	37500	4 073 131 €
UTD HEALTH 6% 02/18	3000	2 817 863 €
VALE 5,625% 09/42	3200000	2 679 967 €
VALE SA 3,75% 23	2050000	2 186 054 €
VALEO 4,875 05/2018	6900000	7 889 789 €
VALEO 5,75% 2017	3800000	4 498 339 €
VALERO 4,5% 10-2015	3560	2 935 663 €
VALERO 6,125%10-2020	4700	4 412 493 €
VALERO EN 6,625 37	2977	2 773 633 €
VALLOUREC 4,25% 17	5000000	5 723 441 €
VAN LAN B 4,625% 14	2000	2 131 490 €
VAN LAN BK 2,87% 16	2200000	2 253 576 €
VATTENFALL TREASURY	90	6 127 202 €
VENTAS REAL 4,25%22	4120000	3 361 096 €
VEOLIA ENV 4,625%27	4100000	4 770 471 €
VEOLIA ENVIRONNEMENT	5250000	6 422 023 €
VER COM 8,25%11-18	265	281 583 €
VERIZ WIRL 8,75% 15	1600	1 974 473 €
VERIZON 5,5 02/18	5800	5 359 792 €
VERIZON 6,40%38 SR	1560	1 611 425 €
VERIZON 7,75%30	1675	1 861 601 €
VERIZON COMM 2,45%22	17945000	13 652 698 €
VERIZON COMM 3,85%42	6526000	4 886 015 €
VIACOM 3,125%12-2022	2500000	1 941 386 €
VIACOM 5,625%150919	2550	2 333 705 €
VIACOM INC 3,875%21	3340	2 739 198 €
VINCI 3,375%12-2020	7100000	7 812 843 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
VINCI 4,125% 04/20	2950000	3 413 863 €
VINCI 4,125% 2017	3000000	3 473 978 €
VINCI 6,25%06 PERP,	1000000	1 070 714 €
VIRG ELEC 6%06-2036	2840	2 858 863 €
VIRGIN MEDI 6,5% 18	3114	2 545 881 €
VIRGINIA ELE 6,35%37	4600	4 781 597 €
VIVEND,4,50% 2013	500000	519 173 €
VIVENDI 3,875% 15	5	535 113 €
VIVENDI 4,125 17	6700000	7 471 387 €
VIVENDI 4,75% 04/22	895000	715 429 €
VIVENDI 4,875 %18	4800000	5 547 238 €
VIVENDI 4,875%2019	1000000	1 164 278 €
VIVFP 4,75% 2021	1300000	1 523 033 €
VODAFONE 5,45%09-19	1630	1 502 673 €
VODAFONE 5,625% 17	1730	1 565 049 €
VODAFONE 5,75%16	3805	3 355 551 €
VODAFONE 6,25% 01/16	500	611 831 €
VODAFONE 7,875 02/30	798	894 455 €
VOLKS IF 7 02/16	5000	6 221 874 €
VOLKS LEAS 2,25% 14	13	1 340 171 €
VOLKS LEAS 2,75% 15	13	689 920 €
VOLKS LEAS 3,25 %18	15	1 668 301 €
VOLKSW LEAS 1,5% 15	5700000	5 822 274 €
VOLKSW LEAS 2,375%22	1700000	1 715 926 €
VOLKSWAGEN 1,875%17	1609000	1 677 239 €
VOLVO T AB 2,375% 17	5343000	5 353 567 €
VORNADO 5% 15/01/22	7400	6 299 218 €
VW 2,125% 2015	459000	480 522 €
VW 3,375% 2016	9	988 236 €
VZ 5,85 15/09/35	4700	4 483 368 €
WACHOVIA 4 3/8%16	40	2 281 657 €
WACHOVIA 4 3/8%18	57	3 175 085 €
WAG 5,25% 15/01/2019	1480	1 339 988 €
WAL MART 4,875% 29	1800	2 346 559 €
WAL MART 5,25% 35	3640	3 362 023 €
WALGREEN 3,1% 22	1175000	904 002 €
WALGREEN 4,4% 42	1405000	1 087 305 €
WALMART 3,625% 0720	11400	9 746 915 €
WAL-MART 6,20%38	1770	1 829 280 €
WAL-MART 6,50%37	3785	4 067 518 €
WATSON 5%09-2014	410	336 342 €
WATSON PHA 3,25%2022	8160000	6 351 577 €
WATSON PHAM 4,625%42	3475000	2 735 744 €
WDCAU 5,75% 09/15	6900	5 896 748 €
WEATH INTL 6,5 36	3000	2 406 565 €
WEATHER 9,625%2019	1800	1 801 223 €
WEATHERFORD 5,95%42	3615000	2 961 637 €
WEINGARTEN RLTY	2680000	2 012 640 €
WELLPOINT 4,65% 43	3650000	2 908 691 €
WELLPOINT 3,3% 23	9550000	7 442 828 €
WELLPT 4,625%2042	1575000	1 237 667 €
WELLS 5,95%06-2036	4015	3 875 448 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
WELLS 4 1/8%16	7700	8 686 885 €
Wells Fa 2,625 0822	7560	7 894 533 €
WELLS FAR 3,5% 03/22	14250000	11 645 330 €
WELLS FARGO 1,5% 18	11165000	8 485 225 €
WELLS FARGO 3,676 16	6945	5 757 755 €
WELLS FARGO 4,6%2021	3200	2 814 790 €
WESFARMERS 2,75% 22	13240000	13 696 093 €
WESPAC 4,25% 2016	3800	4 303 688 €
WESTAR ENR 4,125% 42	2500000	1 979 357 €
WESTERN 5,93% 10/16	4000	3 373 572 €
WESTERN GA 5,375% 21	1610000	1 404 265 €
WESTERN GAS 4%2022	800000	637 338 €
WESTERN UNI 2,375%15	3045000	2 325 262 €
WESTERN UNI 2,875%17	3333000	2 514 000 €
WESTLAKE 3,6%07/22	5538000	4 297 159 €
WESTPAC 3,875%10-17	5075	5 796 684 €
WESTPAC B 4,625 18	2900	2 402 155 €
WESTPAC BK 4,125% 18	1000	1 168 365 €
WILL COS 7,75% 31	511	482 411 €
WILL COS 7,875 21	1400000	1 395 302 €
WILL PART 5,25% 2020	1141	1 006 706 €
WILLIA COS 8,75%32	743	797 211 €
WILLIAMS 4,125% 20	6110	5 042 162 €
WILLIAMS COS 3,70%23	3055000	2 338 160 €
WILLIAMS PA 3,35 22	7500000	5 828 586 €
WILLIAMS PAR 4% 2021	1505	1 222 270 €
WILLIS GRP 5,75% 21	1850	1 607 608 €
WILLIS NORTH 7%09-19	4600	4 204 494 €
WILLOW N0,2 3,375%22	5229000	5 736 218 €
WISCONSIN EN 6,25%67	1500	1 235 870 €
WOLTERS K 6,375%18	3218	4 114 190 €
WPP 5,25%300115	1342	1 522 567 €
WPP FIN 8%09-2014	4250	3 639 102 €
WPP GP 4,375%13	750	776 494 €
WPP GROUP PLC	8967	10 869 144 €
WPS RES 6,11%2066	1500	1 198 966 €
WYETH 5,45% 07-2017	2845	2 576 898 €
WYETH 5,95 04/37	1320	1 328 241 €
WYETH TF6,5% 03/2034	475	501 429 €
WYNDHAM WOR 4,25% 22	7700000	6 060 192 €
XCEL ENERGY 4,8%41	2000	1 718 224 €
XEL 4,50% 2041	3900000	3 275 583 €
XEROX 4,25%15 SR	9680	7 826 818 €
XEROX 6,4%0316	2065	3 589 403 €
XEROX CORP 2,95%17	809000	633 824 €
XL CAPITAL 5,25%14	1140	930 431 €
XL GROUP 5,75%2021	1450	1 310 306 €
XSTRATA 2,375% 2018	1000000	1 006 543 €
XSTRATA FIN 4% 22	2970000	2 289 127 €
XSTRTA CDA 5,25 17	500	586 253 €
XTO ENERGY 5,5 %18	2500	2 310 344 €
YUM 6,875% 15/11/37	900	946 657 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
YUM BRANDS 3,87% 20	1820	1 495 718 €
YUM BRANDS 6,25% 18	5310	4 971 252 €
ZFS FIN,6,45%65	1565	1 276 648 €
ZIGGO FIN 6,125%2017	1666000	1 794 876 €
ZURICH 7,50%09-2039	47	2 944 805 €
ZURICH F,6,5%10-15	4000	4 664 257 €

TCN	
Valeur boursière de la poche	1 427 755 264 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
CR31 0,139% 31/05/12	10000000	7 581 594 €
CR31 0,06% 13/09/12	6000000	4 550 598 €
CR16 0,24% 10/12/12	200000000	199 735 229 €
CR07 0,64% 10/08/12	100000000	99 918 721 €
CR07 0,59% 10/08/12	200000000	199 837 442 €
CR07 0,61% 10/08/12	100000000	99 918 721 €
CR07 0,27% 05/10/12	140000000	139 880 803 €
CR07 0,13% 03/09/12	50000000	49 974 088 €
CR07 0,28% 08/10/12	127000000	126 891 871 €
CR07 0,28% 05/10/12	150000000	149 872 289 €
CR07 0,15% 18/12/12	100000000	99 905 786 €
CR07 0,21% 10/12/12	200000000	199 735 229 €
CR07 0,12% 18/12/12	50000000	49 952 893 €

OPCVM	
Valeur boursière de la poche	6 314 675 868 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
AMUNDI ACT,EMERG,I2	12	69 058 972 €
DIMENSIONAL EMERG	7808131,162	136 408 051 €
BLACKROCK FONDS INDI	28506813,62	431 878 226 €
CAPITAL INTL	549489,35	43 580 000 €
SCHRODERS INTL EMERG	15153975,07	193 516 262 €
VANGUARD EMERG MK	3298926,7	413 931 178 €
COMGEST EMERG 3DEC	6235000	148 071 792 €
ABERDEEN GL EMERG I2	5200712	77 740 467 €
CIP EM,TOT,OPP A7C	7299270,07	71 094 890 €
BNP CASH INVEST I	19125	1 091 539 676 €
ALLIANZ EURO HIGH	28032,458	48 116 873 €
THRE,EUR,H,Y, EUR	18620188,78	41 336 819 €
HSBC EU,C,H,I	2050092,364	71 673 279 €
PIONEER FUNDS EUR HG	37137,697	56 752 343 €
NEUBER BERGMAN	16273999,69	229 593 746 €
JANUS CAP FUND HIGH	627481,763	48 969 659 €
AXA WORLD FUNDS	1176814,859	159 767 970 €
FIDELITY FUND US	5217721,83	61 224 330 €
BNY MELLON GL-EMM	302609245,8	426 829 607 €
STONE HARBOR-EM MKLC	3527672,189	420 623 535 €
BAER LOC,EM,C 3DEC	1831968,54	498 511 099 €

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
HSBC GIF GL	5378059,859	146 999 215 €
FRANK TEMP INV EMKT	20847284,54	387 882 198 €
PICTET FUNDS LUX -EM	273895,2555	75 196 546 €
PICTET FUND LUX	1008569,322	168 681 383 €
ING RENTA EMERG MARK	1461845,501	70 741 613 €
AVIVA I EMERG, MARKT	91402,2965	87 157 837 €
BFT MONET,SI,3DEC	37435,618	503 875 557 €
BNP CASH INVEST I	1257	71 741 980 €
LBPAM TRES,I 5DEC	5694,66274	62 180 763 €

CAPITAL INVESTISSEMENT

Valeur boursière de la poche	641 800 825 €
-------------------------------------	----------------------

Libellé valeur	Quantité	Valeur boursière
ACCESS CAPITAL PA	1	179 341 113 €
ANTIN INFRASTRUCT, A	495 000	31 291 024 €
ANTIN INFRASTRUCT, B	500 000	500 000 €
AXA SEC, FUND IV LP	1	141 171 360 €
LEHMAN BROTHERS INTE	1	172 909 364 €
PANTHEON FRR EUROPE	1	116 587 963 €