

**COMPOSITION DU PORTEFEUILLE DU FRR  
AU 30 JUIN 2018**

**ACTIONS**

Encours sous gestion dans la poche

9 741 883 693 €

Libellé des valeurs	Quantité de titres	Valeur des titres au 30/06/2018	Ratio d'emprise
2CRSI	19 200	181 632,00 €	0,1082%
4IMPRINT GROUP	402 735	7 832 919,10 €	1,4340%
A2A	95 724	142 150,14 €	0,0031%
AAC TECHNO HOLD NV	136 523	1 646 929,46 €	0,0112%
AAREAL BANK	9 218	347 242,06 €	0,0154%
AARHUSKARLSHAMN AB	480 000	6 553 246,08 €	0,1892%
ABB ADR SPONS.	55 861	1 041 577,64 €	0,0026%
ABB LTD NOM.	45 360	849 411,83 €	0,0021%
ABC-MART	31 100	1 457 319,89 €	0,0377%
ABIOMED	4 768	1 670 464,13 €	0,0106%
ABN AMRO GROUP	993 427	22 073 947,94 €	0,1057%
ACADEMEDIA AB	641 496	2 984 873,54 €	0,6101%
ACCESSO TECHNOLOGY	134 544	3 833 899,25 €	0,4965%
ACCIONA	293 912	20 844 239,04 €	0,5133%
ACCOR	21 867	918 851,34 €	0,0075%
ACCSYS TECHNOLOGIE	1 218 531	1 116 174,40 €	1,0334%
ACERINOX	431 203	4 889 842,02 €	0,1562%
ACKERMANS HAAREN	80 445	11 865 637,50 €	0,2402%
ACS ACT.CONSTR.	162 322	5 632 573,40 €	0,0516%
ACS DO18	104 946	92 562,37 €	0,0334%
ACTIVISION	124 547	8 141 344,73 €	0,0163%
ADIDAS NOM.	90 710	16 958 234,50 €	0,0434%
ADIANT PLC	102 786	4 330 472,65 €	0,1101%
ADOBE SYSTEMS	32 606	6 808 846,61 €	0,0067%
ADP (PROMESSE)	158 715	30 743 095,50 €	0,1604%
ADVAN	104 200	779 141,02 €	0,1936%
ADVANCE AUTO PARTS	125 100	14 539 908,36 €	0,1689%
AEGON	6 255 843	32 130 009,65 €	0,2985%
AENA	92 056	14 314 708,00 €	0,0614%
AERCAP HOLDINGS NV	194 111	9 002 707,08 €	0,1308%
AGEAS	464 923	20 089 322,83 €	0,2290%
AHLSSELL AB	1 071 286	5 420 584,70 €	0,2455%
AIA GROUP LTD	559 437	4 189 692,98 €	0,0046%
AIB GROUP PLC	2 073 472	9 641 644,80 €	0,0764%
AIR FRANCE	109 832	767 066,69 €	0,0256%
AIR LIQUIDE	158 900	17 113 530,00 €	0,0371%
AIR LIQUIDE 2020	168 324	18 128 494,80 €	0,0393%
AIRBUS SE	564 739	56 620 732,14 €	0,0728%
AISIN SEIKI	133 900	5 228 701,31 €	0,0454%
AKKA TECHNOLOGIES	56 034	3 434 884,20 €	0,2761%
AKZO NOBEL	162 855	11 940 528,60 €	0,0637%
ALD INTERNATIONAL	433 689	6 340 533,18 €	0,1073%
ALEXION PHARMA. INC	28 744	3 056 458,05 €	0,0129%
ALFA LAVAL	71 227	1 449 785,08 €	0,0170%
ALIBABA SPON.ADR	99 162	15 757 377,29 €	0,0038%
ALLIANZ	325 607	57 638 951,14 €	0,0757%
ALLSTATE	146 441	11 447 621,14 €	0,0423%
ALNYLAM PHARM.	8 010	675 692,60 €	0,0080%

ALPES (COMPAGNIE)	101 391	2 980 895,40 €	0,4153%
ALPHA FINANCIAL	1 332 227	3 630 538,89 €	1,3127%
ALPHABET CL. A	19 751	19 102 078,44 €	0,0066%
ALPHABET CL. C	21 081	20 143 906,17 €	0,0060%
ALS LTD	208 216	993 512,62 €	0,0425%
ALSTOM REGROUPT	1 002 145	39 444 427,20 €	0,4507%
ALTAREA	11 884	2 418 394,00 €	0,0740%
ALTEN	230 698	20 370 633,40 €	0,6819%
ALTICE CL.A	932 808	3 255 499,92 €	0,0689%
ALTICE CL.B	11 072	38 530,56 €	0,0051%
ALTRAN TECHN.	1 095 115	13 601 328,30 €	0,6229%
ALUMINA	458 160	811 826,35 €	0,0159%
AMADEUS IT HOLDING	181 262	12 253 311,20 €	0,0413%
AMAZON COM	33 229	48 377 075,25 €	0,0068%
AMBEA AB	521 829	3 597 132,38 €	0,7717%
AMERICAN AIRLINES	80 779	2 626 329,36 €	0,0175%
AMERICAN EXPRESS	262 884	22 065 549,23 €	0,0305%
AMERICAN INTL GRP	65 116	2 957 004,26 €	0,0073%
AMERICAN WATER WKS	220 500	16 124 611,37 €	0,1222%
AMERISUR RESOURCES	5 784 449	968 053,88 €	0,4768%
AMP	641 805	1 445 909,25 €	0,0222%
AMPHENOL CL.A	11 315	844 591,02 €	0,0038%
AMUNDI	74 621	4 428 010,14 €	0,0370%
ANDEAVOR	39 950	4 488 579,50 €	0,0264%
ANDRITZ AG	145 242	6 602 701,32 €	0,1397%
ANGLO IRISH BANK	1 655 585	- €	0,0000%
ANHEUSER BUSCH S	229 109	19 817 928,50 €	0,0113%
ANSELL	37 497	645 198,98 €	0,0263%
ANTHEM INC	34 833	7 101 450,90 €	0,0134%
ANTOFAGASTA	110 296	1 234 726,52 €	0,0112%
AOI ELECTRONICS	76 600	2 123 439,09 €	0,6383%
AOI TYO HOLDINGS	90 000	1 086 343,80 €	0,3664%
AP MOELLER MAERS.B	313	333 891,31 €	0,0031%
APA GROUP ST.SECU.	1 310 858	8 171 086,76 €	0,1111%
APERGY CORP	17 967	642 475,48 €	0,0232%
APPLE	101 884	16 153 267,31 €	0,0021%
APPLEGREEN	544 010	3 394 622,40 €	0,5932%
APPLIED MATERIALS	66 686	2 638 196,51 €	0,0068%
APPLUS SERVICES	685 317	7 833 173,31 €	0,4792%
APTIV PLC	30 600	2 401 505,72 €	0,0116%
ARCELORMITTAL SA	72 078	1 809 878,58 €	0,0071%
ARCHER DANIELS	396 600	15 567 794,10 €	0,0709%
ARIAKE JAPAN	5 200	383 595,58 €	0,0158%
ARISTOCRAT LEISURE	74 969	1 465 980,32 €	0,0117%
ARIX BIOSCIENCE PLC	1 092 377	2 439 582,27 €	0,8102%
ARKEMA	135 994	13 789 791,60 €	0,1777%
AROUNDTOWN SA	1 190 643	8 376 173,51 €	0,1088%
ASAHI GLASS	120 000	4 003 906,48 €	0,0517%
ASAHI GROUP HOLDIN L	85 700	3 758 710,89 €	0,0177%
ASAHI INTEC	99 300	3 217 252,52 €	0,0768%
ASAHI KASEI	628 400	6 841 647,74 €	0,0448%
ASCENDAS REAL EST	1 181 945	1 960 070,86 €	0,0403%
ASCENTIAL PLC	1 350 323	6 910 795,39 €	0,3370%
ASCOM HOLDING	91 391	1 418 931,30 €	0,2539%
ASHTREAD GROUP	357 652	9 192 548,15 €	0,0738%
ASM PACIFIC TECHN.	214 561	2 323 642,73 €	0,0531%
ASML HOLDING	64 566	10 956 850,20 €	0,0150%
ASML HOLDING	9 700	1 644 733,84 €	0,0022%
ASOS PLC	51 231	3 534 930,31 €	0,0613%
ASR NEDERLAND	15 151	529 981,98 €	0,0107%
ASSA ABLOY AB	48 004	877 362,50 €	0,0045%
ASSICURAZ.GEN.ORD.	1 009 346	14 504 302,02 €	0,0645%
ASSOCIATED BRITISH	17 029	527 227,93 €	0,0022%
ASSYSTEM	69 952	1 906 192,00 €	0,4465%
ASTRAZENECA	81 137	4 819 502,02 €	0,0064%
ASX	38 806	1 581 267,14 €	0,0200%

AT AND T	344 548	9 475 770,87 €	0,0047%
ATEME	35 547	628 470,96 €	0,3419%
AT-GROUP	49 100	1 101 035,62 €	0,1396%
ATLANTIA	262 837	6 655 032,84 €	0,0318%
ATLAS ARTERIA LTD	325 273	1 323 570,05 €	0,0476%
ATLAS COPCO B	18 458	414 668,37 €	0,0047%
ATLASSIAN CORPORAT	15 772	844 559,50 €	0,0149%
ATOS ORIGIN	320 864	37 525 044,80 €	0,3002%
AUBAY	13 000	465 400,00 €	0,0990%
AUCKLAND INTL ARPT	433 873	1 705 853,43 €	0,0361%
AURELIUS	78 820	4 011 938,00 €	0,2562%
AURIZON HLDGS LTD	586 783	1 607 879,00 €	0,0295%
AURUBIS AG	89 262	5 846 661,00 €	0,1986%
AUS.NZL BKG GROUP	289 253	5 169 285,36 €	0,0101%
AUSNET SERVICES	1 745 511	1 772 905,43 €	0,0483%
AVACTA	607 429	199 190,83 €	0,5261%
AVANZA HOLDING BK	270 076	11 894 317,81 €	0,8921%
AVEVA GROUP PLC	118 425	3 596 873,98 €	0,0734%
AVIVA	386 264	2 201 357,56 €	0,0099%
AVNET	21 423	786 974,84 €	0,0185%
AXA	3 864 660	81 215 829,92 €	0,1595%
AXEL SPRINGER	125 170	7 754 281,50 €	0,1160%
AXWAY SOFTWARE	30 000	582 000,00 €	0,1413%
B&S GROUP SA	282 735	4 034 628,45 €	0,3359%
BAKKAFROST	100 000	4 751 996,64 €	0,2047%
BAKKAVOR GROUP PLC	1 576 065	3 439 594,56 €	0,2720%
BALOISE HOLDING	3 571	444 469,14 €	0,0073%
BALYO	49 043	215 789,20 €	0,1735%
BANCA GENERALI	249 226	5 318 482,84 €	0,2133%
BANCA POP.EMILIA	389 073	1 831 366,62 €	0,0808%
BANCO BILBAO VIZC.	3 105 281	18 861 476,79 €	0,0466%
BANCO BPM S.P.A	1 397 938	3 511 620,26 €	0,0923%
BANCO SABADELL	5 145 760	7 386 738,48 €	0,0914%
BANDO CHEM.IND.	89 900	850 174,41 €	0,1904%
BANK AMERICA	1 967 733	47 510 079,45 €	0,0197%
BANK IRELAND	987 219	6 599 559,02 €	0,0915%
BANK OF EAST ASIA	312 842	1 070 704,17 €	0,0111%
BANK QUEENSLAND	52 465	338 323,22 €	0,0132%
BANKIA S.A	210 822	676 106,15 €	0,0068%
BANKINTER	1 090 819	9 099 612,09 €	0,1214%
BARCLAYS	954 112	2 039 092,76 €	0,0056%
BARRATT DEV.	232 398	1 354 417,70 €	0,0229%
BARRICK GOLD	95 029	1 068 674,38 €	0,0081%
BARRY CALLEBAUT N.	104	159 675,68 €	0,0019%
BASF SE	283 745	23 241 552,95 €	0,0309%
BASIC-FIT	321 434	9 289 442,60 €	0,5880%
BASTIDE LE CONFORT	40 432	1 997 340,80 €	0,5508%
BASWARE	60 822	2 189 592,00 €	0,4223%
BAYER	445 273	42 011 507,55 €	0,0477%
BAYER AG DS18	18	30,10 €	0,0000%
BAYER.MOTO.PRIV.	235 885	16 110 945,50 €	0,4242%
BB AND T	359 900	15 548 247,18 €	0,0465%
BBA AVIATION	1 167 850	4 508 441,11 €	0,1131%
BCA MARKETPLACE	1 730 138	4 304 069,20 €	0,2169%
BCA MEDIOLANUM	467 264	2 712 467,52 €	0,0631%
BCO ESPIRITO SANTO	3 323 765	- €	0,0591%
BCO SANT.CENT.HISP	10 234 392	46 996 328,06 €	0,0634%
BCP BCO COMERCIAL	1 218 383	313 611,78 €	0,0081%
BECTON DICKINSON	68 463	14 047 360,95 €	0,0256%
BEIERSDORF NOM.	149 163	14 504 610,12 €	0,0592%
BELC	51 400	2 329 070,39 €	0,2463%
BELIER	15 047	878 744,80 €	0,2286%
BELIMO HOLDING	2 887	10 732 712,29 €	0,4694%
BEND.AND ADEL.BANK	17 548	120 377,37 €	0,0036%
BERKELEY UNIT	30 871	1 321 272,52 €	0,0236%
BERKSHIRE HATHAWAY B	65 258	10 432 448,89 €	0,0048%

BERTRANDT	40 000	3 254 000,00 €	0,3944%
BGP HOLDINGS	3 056 274	- €	0,0000%
BHP BILLITON	107 637	2 309 815,64 €	0,0034%
BIC	150 625	11 959 625,00 €	0,3229%
BIG YELLOW	1 185 046	12 777 083,29 €	0,7113%
BILFINGER BERGER	12 961	564 581,16 €	0,0293%
BIOMERIEUX	374 720	28 890 912,00 €	0,3166%
BIOTAGE AB	650 000	7 144 156,48 €	1,0044%
BLUESCOPE STEEL	72 335	790 091,19 €	0,0132%
BMW	293 473	22 782 308,99 €	0,0488%
BNP PARIBAS	1 522 978	81 007 199,82 €	0,1219%
BOC AVIATION LTD	264 800	1 409 287,17 €	0,0382%
BOC HKG HOLD.	521 420	2 103 337,79 €	0,0049%
BOEING	89 702	25 776 984,31 €	0,0156%
BOIRON	58 788	4 273 887,60 €	0,3028%
BOLIDEN NV18	50 929	1 416 956,35 €	0,0186%
BOLLORE INVEST.	3 379 204	13 462 748,73 €	0,1154%
BONDUELLE	111 541	3 452 193,95 €	0,3455%
BONGRAIN	6 735	505 125,00 €	0,0480%
BOOKING HOLDINGS INC	12 059	20 936 729,31 €	0,0254%
BOOZT AB	619 499	4 317 851,51 €	1,0853%
BORAL (NEW)	136 193	562 802,36 €	0,0116%
BORG WARNER	29 574	1 093 241,27 €	0,0142%
BORR DRILLING LTD	607 465	2 489 610,66 €	0,1140%
BOSHIWA INTL	122 000	- €	0,0059%
BOSTON SCIENTIFIC	105 631	2 958 446,06 €	0,0076%
BOUYGUES	930 527	34 345 751,57 €	0,2540%
BP	976 250	6 383 958,56 €	0,0049%
BP PLC SPONSORED	529 148	20 693 672,80 €	0,0159%
BPOST - PROMESSES	294 852	3 989 347,56 €	0,1474%
BRAMBLES	600 793	3 376 181,39 €	0,0377%
BREMBO SPA	575 000	6 664 250,00 €	0,1722%
BRENNTAG	227 586	10 860 403,92 €	0,1473%
BRIDGESTONE	162 500	5 444 574,35 €	0,0213%
BRIGHTOIL PETRO HLD	508 000	- €	0,0050%
BRITISH LAND	196 284	1 491 967,04 €	0,0201%
BRITISH SKY BROAD.	49 829	823 487,13 €	0,0029%
BROADCOM CORP	26 227	5 450 489,72 €	0,0063%
BROTHER INDUSTRIES	369 700	6 254 875,17 €	0,1410%
BT GROUP	347 057	854 740,94 €	0,0035%
BUNZL	15 871	411 872,51 €	0,0047%
BURBERRY GROUP	68 037	1 661 784,59 €	0,0165%
BURCKHARDT COMPRES	3 859	1 173 660,59 €	0,1135%
BUREAU VERITAS	1 748 933	39 980 608,38 €	0,3955%
BUZZI UNICEM ORD.	243 522	5 111 526,78 €	0,1473%
C. UYEMURA & CO	91 000	5 474 479,93 €	0,9212%
CAFE DE CORAL HOLD	684 137	1 419 069,21 €	0,1168%
CAIRN ENERGY	658 401	1 861 256,86 €	0,1117%
CAIRN HOMES LTD	1 434 218	2 547 171,17 €	0,1818%
CALTEX AUSTRALIA	247 240	5 091 247,69 €	0,0948%
CANCOM SE	52 583	4 601 012,50 €	0,1501%
CAP GEMINI	426 583	49 142 361,60 €	0,2527%
CAPITACOMM.REIT	1 868 035	1 947 886,62 €	0,0499%
CAPITAL ONE FCIAL	26 571	2 091 452,10 €	0,0056%
CAPITALAND	636 700	1 263 841,20 €	0,0153%
CAPITAMALL TRST FD	2 563 566	3 333 384,60 €	0,0722%
CARDINAL HEALTH	159 165	6 656 697,31 €	0,0515%
CARGOTEC B	87 822	3 806 205,48 €	0,1591%
CARL ZEISS MEDITEC	80 220	4 688 859,00 €	0,0897%
CARLSBERG PREF.S.B	4 737	477 851,64 €	0,0040%
CARNIVAL	8 987	441 753,71 €	0,0052%
CARREFOUR	1 292 840	17 931 690,80 €	0,1638%
CASINO GUICHARD	291 558	9 694 303,50 €	0,2657%
CATHAY PAC.AIRWAYS	839 000	1 130 274,73 €	0,0213%
CATTOLICA ASSICUR.	27 002	192 929,29 €	0,0155%
CECONOMY AG	823 631	5 879 078,07 €	0,2309%

CELLECTIS	38 000	934 800,00 €	0,0896%
CELLNEX TELECOM	423 340	9 144 144,00 €	0,1827%
CEMEX ADR OPC A-B	196 506	1 104 089,21 €	0,0130%
CENTENE	23 185	2 446 682,24 €	0,0113%
CENTRAL JAP.RAILW.	31 100	5 521 462,81 €	0,0151%
CENTRICA	270 587	482 366,04 €	0,0048%
CENTURY LEAS. SYS.	89 700	4 355 860,53 €	0,0841%
CERV INFO SOL	1 153 724	10 614 260,80 €	0,5908%
CFG LTD	223 873	- €	0,0061%
CHALLENGER FCIAL	77 740	581 992,28 €	0,0127%
CHAMPION REIT	2 089 318	1 188 363,12 €	0,0357%
CHARGEURS	205 957	5 264 260,92 €	0,8757%
CHEUNG KONG PROPER	272 634	1 854 278,48 €	0,0074%
CHEVRON CORP	295 060	31 951 039,19 €	0,0154%
CHINA EVERBRIGHT	582 000	644 269,89 €	0,0095%
CHINA HIGH PRECIS.	152 000	- €	0,0147%
CHINA MENGNIU	866 437	2 516 086,25 €	0,0221%
CHINA METAL RECYCLIN	89 400	- €	0,0000%
CHINA MILK PROD TP	239 000	- €	0,0000%
CHINA TRAVEL INTL	3 492 000	1 166 547,85 €	0,0640%
CHNA ANIM HLTH CRE	167 770	- €	0,0085%
CHOCOL.LINDT SPRUN	5	325 182,21 €	0,0037%
CHOCOLAD.LINDT BP	48	266 218,14 €	0,0045%
CHOW TAI FOOK JEWL	1 993 420	1 923 791,37 €	0,0199%
CHR. HANSEN HOLD.	172 700	13 661 720,37 €	0,1310%
CHUBB LTD	27 058	2 943 691,63 €	0,0058%
CIGNA	171 423	24 952 540,66 €	0,0704%
CIMAREX ENERGY	19 962	1 739 483,43 €	0,0209%
CIMIC GROUP LTD	16 180	433 118,59 €	0,0050%
CINEWORLD GROUP	2 000 000	6 006 671,57 €	0,1459%
CISCO SYSTEMS	1 069 542	39 417 919,81 €	0,0234%
CITIGROUP	153 226	8 782 393,83 €	0,0061%
CITY DEVELOPMENTS	216 698	1 487 803,72 €	0,0239%
CK HUTCHISON	307 748	2 795 280,93 €	0,0080%
CLARIANT NOM.	67 017	1 376 930,99 €	0,0202%
CLARKSON	160 000	4 161 248,37 €	0,5277%
CLEAN HARBORS	12 700	604 243,93 €	0,0226%
CLOETTA	613 431	1 596 286,66 €	0,2168%
CNA HONGXING SPRT	449 000	- €	0,0160%
CNH INDUSTRIAL NV	904 595	8 228 196,12 €	0,0667%
CNP ASSURANCES	1 415 315	27 584 489,35 €	0,2061%
COATS GROUP PLC	4 370 309	3 839 803,35 €	0,3063%
COCA COLA EUR	323 244	11 251 161,14 €	0,0665%
COCA-COLA	423 200	15 897 864,76 €	0,0100%
COCA-COLA AMATIL	667 845	3 888 225,54 €	0,0922%
COCA-COLA HBC	46 215	1 322 668,23 €	0,0125%
COCHLEAR	17 117	2 168 276,10 €	0,0297%
COFACE	143 817	1 369 137,84 €	0,0915%
COGELEC	166 707	2 055 497,31 €	1,8735%
COLRUYT	340 002	16 615 897,74 €	0,2264%
COM HEM HOLDING	154 825	2 158 232,25 €	0,0872%
COMCAST CL.A	718 938	20 203 293,89 €	0,0157%
COMFORTDELGRO	1 187 308	1 752 676,78 €	0,0548%
COMMERZBANK NV	1 059 350	8 698 322,85 €	0,0846%
COMPASS GROUP PLC	74 730	1 367 676,88 €	0,0047%
COMPUGROUP MEDICAL	178 523	7 855 012,00 €	0,3354%
COMPUTERSHARE	189 831	2 214 014,26 €	0,0350%
COMSYS HOLDINGS	140 000	3 181 628,73 €	0,0993%
COMW.BK AUSTRALIA	97 604	4 500 951,45 €	0,0055%
CONOCOPHILLIPS	641 441	38 248 573,87 €	0,0552%
CONSORT MEDICAL	300 000	4 043 647,88 €	0,6086%
CONSTELLATION CL.A	14 139	2 650 509,98 €	0,0084%
CONTACT ENERGY	624 263	2 117 741,05 €	0,0871%
CONTINENTAL	58 483	11 436 350,65 €	0,0292%
CONVATEC GROUP	2 237 144	5 373 091,95 €	0,1141%
COSMOS PHARMA.	9 900	1 720 891,07 €	0,0495%

COSTAR GROUP	3 200	1 130 928,87 €	0,0088%
COVESTRO AG	349 526	26 794 663,16 €	0,1726%
CRANEWARE	133 414	3 198 254,99 €	0,5004%
CRANSWICK	100 000	3 817 493,07 €	0,1939%
CREATE SD HOLDINGS	56 900	1 401 340,20 €	0,0852%
CREDIT AGRICOLE	1 756 140	20 081 460,91 €	0,0613%
CREDIT SUISSE GRP	110 978	1 431 078,71 €	0,0043%
CREST NICHOLSON HG	390 174	1 719 792,22 €	0,1519%
CRH	39 247	1 191 146,45 €	0,0047%
CRH PLC	50 452	1 527 539,03 €	0,0061%
CRITERIA CAIXACORP	2 022 336	7 494 777,22 €	0,0338%
CRODA INTERNATIO PLC	6 442	349 799,11 €	0,0049%
CROWN	211 541	1 807 241,80 €	0,0308%
CROWN CASTLE INTER	50 282	4 643 403,06 €	0,0121%
CSL	31 896	3 887 993,62 €	0,0070%
CSR	534 966	1 553 913,39 €	0,1061%
CTS EVENTIM	471 247	19 877 198,46 €	0,4909%
CUMMINS	29 622	3 374 353,13 €	0,0181%
CVS CAREMARK	213 390	11 761 077,90 €	0,0210%
CVS GROUP	193 278	2 487 141,56 €	0,2747%
CYBERAGENT	26 100	1 344 115,58 €	0,0206%
CYBERDYNE INC	118 900	1 193 379,09 €	0,0866%
DAH SING BANKING	600 661	1 078 048,12 €	0,0428%
DAH SING FINANCIAL	150 058	750 294,10 €	0,0448%
DAICEL CHEM.IND.	70 000	663 606,13 €	0,0200%
DAIDO METAL	157 100	1 371 487,98 €	0,3377%
DAIFUKU	10 400	390 431,14 €	0,0082%
DAI-ICHI MUTUAL LIFE	62 100	948 856,24 €	0,0052%
DAIKIN INDUSTRIES	17 400	1 785 426,80 €	0,0059%
DAIKYONISHIKAWA	160 000	2 007 984,62 €	0,2165%
DAIMLERCHRYSLER	647 623	35 703 455,99 €	0,0605%
DAISEKI	30 800	775 217,54 €	0,0716%
DAIWA HOUSE IND.	199 100	5 813 331,97 €	0,0299%
DAIWA SECU.GRP	54 800	272 593,81 €	0,0032%
DALATA HOTEL GROUP	908 420	6 340 771,60 €	0,4930%
DANAHER	148 898	12 584 689,85 €	0,0213%
DANSKE BANK	27 264	730 935,89 €	0,0030%
DASSAULT AVIATION	7 981	13 024 992,00 €	0,0956%
DASSAULT SYSTEMES	543 705	65 244 600,00 €	0,2071%
DAVIDE CAMPARI	2 133 432	15 030 028,45 €	0,1837%
DBS GROUP HOLDINGS	179 127	2 994 170,34 €	0,0070%
DE LONGHI	182 705	4 436 077,40 €	0,1222%
DECHRA PHARMACEUT	299 955	9 436 024,31 €	0,2931%
DELIVERY HERO AG	4 490	204 923,60 €	0,0024%
DELTA AIR LINES	76 393	3 241 410,84 €	0,0111%
DELTA PLUS GROUP	6 670	310 822,00 €	0,0906%
DENA	55 300	888 144,25 €	0,0367%
DENSO	111 700	4 674 474,98 €	0,0141%
DERICHEBOURG	311 688	1 689 348,96 €	0,1902%
DERWENT LONDON	56 357	1 979 361,59 €	0,0505%
DEU.LUFTHANSA NOM.	628 329	12 943 577,40 €	0,1327%
DEUTSCHE BANK NOM.	1 528 353	14 094 471,37 €	0,0739%
DEUTSCHE BORSE	146 201	16 688 844,15 €	0,0758%
DEUTSCHE POST NOM.	615 690	17 220 849,30 €	0,0499%
DEUTSCHE TELEKOM	2 081 307	27 618 943,89 €	0,0437%
DEUTSCHE WOHN.POR.	490 090	20 289 726,00 €	0,1373%
DEUTZ	568 229	3 758 834,84 €	0,4701%
DEVOTEAM	10 355	1 009 612,50 €	0,1242%
DEXCOM	15 600	1 269 057,43 €	0,0177%
DEXUS PTY.UNIT	421 603	2 590 662,66 €	0,0414%
DIA	852 250	2 126 363,76 €	0,1369%
DIAGEO	157 465	4 846 720,53 €	0,0064%
DIASORIN	75 387	7 365 309,90 €	0,1347%
DIGNITY PLC	565 000	6 427 206,42 €	1,1298%
DIRECT ENERGIE	37 387	1 573 244,96 €	0,0813%
DIRECT LINE INSU GRP	226 103	876 697,22 €	0,0164%

DISCOVER FINANCIAL	45 784	2 761 039,30 €	0,0134%
DISNEY WALT-DISNEY	152 800	13 716 729,90 €	0,0103%
DNA LTD	43 479	891 319,50 €	0,0329%
DNB NOR	47 268	791 277,05 €	0,0029%
DOLLAR GENERAL	129 800	10 961 654,75 €	0,0489%
DOMAIN HOLDINGS	116 091	236 560,57 €	0,0200%
DOMETIC GROUP	680 566	5 733 880,46 €	0,2301%
DOMINOS PIZZA ENT	4 013	132 615,40 €	0,0047%
DOMINO'S PIZZA UK	1 000 000	3 922 655,06 €	0,2119%
DONT NOD ENTER	24 219	588 521,70 €	0,5182%
DOVER	20 152	1 263 437,45 €	0,0136%
DOWA HOLDINGS	147 900	3 905 537,03 €	0,2386%
DOWDUPONT INC	588 163	33 207 746,96 €	0,0255%
DOWNER EDI	253 069	1 085 816,87 €	0,0426%
DSV	8 966	620 461,11 €	0,0048%
DTS	92 700	2 949 656,56 €	0,3675%
DULUX GROUP	939 216	4 546 894,32 €	0,2413%
DXC TECHNOLOGY CIEA	42 743	2 951 062,68 €	0,0152%
E.ON	2 714 156	24 845 384,03 €	0,1233%
EAGLE INDUSTRY	341 800	4 709 791,01 €	0,6869%
EAST JAPAN RAILWAY	11 800	968 554,10 €	0,0031%
EATON CORP	31 938	2 044 491,56 €	0,0074%
EBAY	62 516	1 941 527,27 €	0,0063%
ECOLAB	7 932	953 361,79 €	0,0027%
EDENRED	802 731	21 721 900,86 €	0,3353%
EDF	2 430 015	28 625 576,70 €	0,0807%
EDF PF 20 N	269 457	3 174 203,46 €	0,0090%
EDISON INTL	27 990	1 516 789,26 €	0,0086%
EDP ENERG.PORTUGAL	6 612 168	22 481 371,20 €	0,1808%
EDP RENOVAVEIS	2 613 399	23 337 653,07 €	0,2996%
EI TOWERS	80 963	3 833 598,05 €	0,2865%
EIFFAGE	204 393	19 045 339,74 €	0,2086%
ELECTROLUX B	11 798	230 427,48 €	0,0039%
ELECTRONIC ARTS A	60 616	7 321 372,38 €	0,0199%
ELEKTA S.B	1 254 156	14 168 676,38 €	0,3403%
ELEMENTIS	1 104 700	3 157 891,78 €	0,2380%
ELI LILLY ORD	251 400	18 373 484,65 €	0,0234%
ELIOR	834 267	10 311 540,12 €	0,4742%
ELIS	1 215 843	23 879 156,52 €	0,5530%
ELISA CORP.S.A	222 913	8 842 958,71 €	0,1332%
EMS CHEMIE HOL.NOM	387	212 468,62 €	0,0017%
ENAGAS	985 760	24 683 430,40 €	0,4129%
ENEL ENERG.ELET.	2 437 933	11 597 247,28 €	0,0240%
ENENSYS	17 409	184 535,40 €	0,3123%
ENERGEN CORP	22 766	1 419 913,60 €	0,0233%
ENERGIZER HLDG INC	164 700	8 881 428,63 €	0,2756%
ENI	14 973	238 160,54 €	0,0004%
ENTERGY	247 752	17 143 492,00 €	0,1370%
ENTERTAINMENT ONE	1 100 000	4 574 885,51 €	0,2376%
EOG RESOURCES	147 300	15 698 290,44 €	0,0254%
EPIROC AKTIEBOLAG	18 458	144 908,62 €	0,0047%
EQUINIX INC	3 950	1 454 383,54 €	0,0050%
EQUITABLE CORP	39 288	1 856 804,28 €	0,0149%
EQUITY RESIDENTIAL	32 628	1 779 861,52 €	0,0089%
ERAMET	3 464	390 392,80 €	0,0130%
ERSTE BANK OSTERR.	36 544	1 306 448,00 €	0,0085%
ESPRIT HOLDINGS	3 377 241	899 619,33 €	0,1790%
ESSENTRA PLC	712 009	3 867 802,61 €	0,2707%
ESSILOR INTL	273 596	33 077 756,40 €	0,1248%
ESSITY AKTIEBOLAG	28 835	610 661,85 €	0,0045%
EURAZEO	189 360	12 298 932,00 €	0,2427%
EUROFINS SCIENT.	53 478	25 476 919,20 €	0,3019%
EURONEXT	62 528	3 404 649,60 €	0,0893%
EUROPCAR GROUP	714 266	6 381 966,72 €	0,4436%
EUTELSAT COMM.PROM	855 730	15 202 043,45 €	0,3676%
EVEREST REINS.GRP	9 462	1 867 844,43 €	0,0232%

EVONIK INDUSTRIES	612 709	17 970 754,97 €	0,1315%
EXEDY	18 400	488 015,73 €	0,0379%
EXELON	275 194	10 040 909,94 €	0,0285%
EXOR NV	100 484	5 797 926,80 €	0,0417%
EXPERIAN	99 188	2 102 424,45 €	0,0108%
FACEBOOK CL A	146 073	24 311 511,60 €	0,0061%
FAIRFAX MEDIA	578 937	274 777,09 €	0,0252%
FAROE PETROLEUM	526 703	873 123,31 €	0,1412%
FAST RETAILING	18 400	7 243 405,50 €	0,0173%
FAURECIA	339 632	20 758 307,84 €	0,2460%
FCC	120 000	2 899 700,52 €	0,2279%
FE NEW N.V.	35 400	4 124 100,00 €	0,0188%
FERGUSON	27 929	1 942 255,33 €	0,0120%
FERMENTALG	62 678	217 806,05 €	0,3656%
FERROVIAL	481 112	8 455 543,41 €	0,0651%
FIAT CHRYSLER	2 163 341	35 321 480,52 €	0,1395%
FIDELITY NATIONAL	14 403	1 307 995,45 €	0,0044%
FIELMANN	103 165	6 117 684,50 €	0,1228%
FIFTH THIRD BCP	298 100	7 327 711,88 €	0,0447%
FIGEAC AERO	34 000	526 320,00 €	0,1068%
FINANCIERE ODET	4 831	3 971 082,00 €	0,0734%
FINECOBANK	803 855	7 774 885,56 €	0,1321%
FINMECCANICA	530 378	4 490 180,15 €	0,0917%
FIRESTONE DIAMONDS	4 239 789	246 903,52 €	0,8092%
FIRST PACIFIC	3 638 366	1 505 402,01 €	0,0838%
FISHER PAYKEL HEA.	206 324	1 781 532,87 €	0,0360%
FISHER PLC	330 000	6 522 756,83 €	0,6565%
FLETCHER BUILDING	216 067	870 808,46 €	0,0253%
FLIGHT CENTRE	46 739	1 882 633,43 €	0,0462%
FMC	17 187	1 313 221,93 €	0,0128%
FNAC DARTY	82 000	6 678 900,00 €	0,3061%
FONC.DES REGIONS	230 839	20 567 754,90 €	0,3066%
FONC.FIN.PARTICIP.	63 060	6 671 748,00 €	0,2515%
FORTESCUE METALS	760 168	2 111 845,03 €	0,0244%
FORTIVE	27 750	1 832 728,79 €	0,0079%
FOSTER ELECTRIC	112 600	1 385 257,30 €	0,4181%
FOXCONN INTERC TEC	379 000	146 883,99 €	0,0056%
FP	63 800	3 019 214,58 €	0,1441%
FRAPORT AG	226 281	18 695 336,22 €	0,2447%
FRASERS CENTREPOIN	149 800	155 262,41 €	0,0051%
FREENET AG	15 791	358 297,79 €	0,0123%
FRESENIUS	103 563	7 125 134,40 €	0,0186%
FRESENIUS MED.CARE	157 947	13 643 461,86 €	0,0511%
FRESNILLO PLC	9 040	116 890,82 €	0,0012%
FUCHS PETR.ORD.DEM	45 541	1 844 410,50 €	0,0655%
FUCHS PETROLUB PF	5 861	247 568,64 €	0,0084%
FUGRO	83 121	1 033 609,64 €	0,0983%
FUJI ELECTRIC HOLD	200 000	1 305 251,86 €	0,0268%
FUJI RG REGISTRED	203 300	3 122 040,28 €	0,2078%
FUJITSU	53 000	275 319,99 €	0,0026%
FUKUOKA FIN.GRP.	442 000	1 903 703,65 €	0,0514%
FURUKAWA ELECTRIC	27 000	809 016,44 €	0,0382%
GALAXY	709 698	4 706 811,01 €	0,0164%
GALLIFORD TRY	300 000	2 963 193,31 €	0,2702%
GALP ENERGIA CL.B	770 144	12 580 302,25 €	0,0929%
GAMA AVIATION	475 414	1 096 675,03 €	0,7474%
GAMESA CORPORACION	372 580	4 286 532,91 €	0,0547%
GAS NATURAL SDG	736 250	16 698 150,00 €	0,0736%
GAZTRANSPORT TECHN	50 244	2 637 810,00 €	0,1355%
GEA GROUP	98 391	2 842 515,99 €	0,0545%
GEBERIT NOM.	1 361	499 978,35 €	0,0037%
GECINA NOM.	362 417	51 934 356,10 €	0,4755%
GEMALTO	153 250	7 634 915,00 €	0,1688%
GEN.PROPERTY TRUST	1 352 523	4 330 949,49 €	0,0749%
GENERAL ELECTRIC	1 532 300	17 861 850,03 €	0,0176%
GENMAB	11 119	1 469 659,39 €	0,0181%



GENTING SINGAPORE	1 648 400	1 263 260,78 €	0,0137%
GENUS PLC	294 104	8 766 417,64 €	0,4779%
GILEAD SCIENCES	214 947	13 041 707,41 €	0,0166%
GIVAUDAN NOM.	437	848 858,41 €	0,0047%
GK SPARK PLUG	100 000	2 443 480,97 €	0,0479%
GLANBIA	235 949	3 751 589,10 €	0,0797%
GLAXOSMITHKLINE	298 336	5 160 789,43 €	0,0060%
GLENVEAGH PROPERT	2 956 440	3 399 906,00 €	0,3393%
GLOBAL PAYMENTS	37 542	3 584 906,50 €	0,0237%
GLORY LTD	24 200	580 094,75 €	0,0353%
GOLDMAN SACHS	17 224	3 253 905,77 €	0,0046%
GPE BRUXEL.LAMBERT	99 915	9 024 322,80 €	0,0619%
GPE EUROTUN.REGPT	1 368 360	16 071 388,21 €	0,2488%
GRAINCORP	51 231	248 990,05 €	0,0224%
GRANDVISION NV	169 085	3 254 886,25 €	0,0665%
GREAT EAGLE HOLD.	189 898	794 010,16 €	0,0272%
GREEN REIT PLC	1 941 165	2 872 924,20 €	0,2796%
GRENKELEASING AG	77 924	7 624 863,40 €	0,1681%
GRIFOLS CL.B	598 841	11 054 604,86 €	0,2291%
GRIFOLS CL A	800 629	20 640 215,62 €	0,1879%
GROUPE CRIT	13 310	1 068 793,00 €	0,1183%
GROUPE DANONE	534 188	33 584 399,56 €	0,0780%
GROUPE OPEN	12 440	393 726,00 €	0,1452%
GRUBHUB	11 614	1 043 573,93 €	0,0128%
GUERBET	80 264	4 591 100,80 €	0,6384%
GULF MARINE SERV	3 608 050	1 697 233,90 €	1,0310%
GUOTAI JUNAN INTER	1 093 002	202 850,82 €	0,0142%
GVC HOLDINGS	627 152	7 453 347,11 €	0,1084%
GYM GROUP PLC	1 200 727	3 733 814,95 €	0,8703%
HAITONG INTERNATIO	616 822	241 073,67 €	0,0109%
HAKUTO	95 400	1 217 178,29 €	0,3952%
HALMA	563 991	8 737 125,23 €	0,1486%
HAMAMATSU	95 200	3 504 013,57 €	0,0577%
HAMMERSON	39 541	233 664,58 €	0,0051%
HANG LUNG GROUP	400 123	960 999,35 €	0,0294%
HANG LUNG PROPERT.	664 073	1 173 008,71 €	0,0148%
HANG SENG BANK	152 450	3 265 376,99 €	0,0080%
HANNOVER RUCK.NOM.	98 950	10 567 860,00 €	0,0821%
HANWA	37 600	1 228 390,47 €	0,0888%
HARMONIC DRIVE SYS	9 100	330 016,85 €	0,0094%
HARVEY NORMAN	132 394	278 159,78 €	0,0119%
HASEKO	382 000	4 522 311,07 €	0,1270%
HCA HOLDINGS	54 770	4 812 986,17 €	0,0158%
HCP	423 465	9 364 794,91 €	0,0901%
HEALTHSCOPE LTD	674 845	943 809,30 €	0,0388%
HEIDELBERGCEMENT	24 660	1 777 492,80 €	0,0124%
HEINEKEN	190 961	16 426 465,22 €	0,0332%
HEINEKEN HOLDING	333 544	27 383 962,40 €	0,1158%
HENDERSON LAND	320 354	1 451 393,40 €	0,0073%
HENKEL PF	142 326	15 584 697,00 €	0,0799%
HENKEL POR	327 443	31 188 945,75 €	0,1260%
HERA	3 197 609	8 537 616,03 €	0,2147%
HERMES INTL	50 764	26 590 183,20 €	0,0481%
HEWLETT PACKARD	156 807	3 047 364,85 €	0,0099%
HEXAGON B	12 610	603 040,24 €	0,0037%
HI LEX	160 300	3 476 868,51 €	0,4194%
HILTON WORLDWIDE	66 183	4 487 213,64 €	0,0222%
HISCOX	250 000	4 311 075,93 €	0,0866%
HITACHI	2 032 000	12 280 898,25 €	0,0420%
HKG AND CHINA GAS	3 320 609	5 444 958,45 €	0,0216%
HKG EXCHANGES	61 136	1 575 128,25 €	0,0049%
HOCHTIEF	36 211	5 605 462,80 €	0,0563%
HOME DEPOT	49 144	8 212 063,21 €	0,0043%
HONDA MOTOR	192 800	4 849 678,75 €	0,0106%
HONGKONG ELECTRIC	51 000	305 389,22 €	0,0024%
HOPEWELL HOLDINGS	673 000	1 969 050,05 €	0,0775%

HOPEWELLE HIGHWAY	3 434 509	1 792 253,56 €	0,1114%
HOSHIZAKI ELECTRIC	40 400	3 501 941,25 €	0,0558%
HOSTELWORLD GROUP	783 432	2 790 536,33 €	0,8197%
HOWDEN	1 073 098	6 506 418,82 €	0,1763%
HOYA	19 600	954 661,83 €	0,0051%
HSBC HOLDINGS	940 923	7 561 643,87 €	0,0047%
HUFVUDSTADEN LIB.A	275 000	3 377 964,37 €	0,1355%
HUGO BOSS	99 707	7 753 216,32 €	0,1416%
HUHTAMAKI	398 090	12 615 472,10 €	0,3694%
HUMANA	8 425	2 147 687,68 €	0,0061%
HURRICANE ENERGY	1 512 415	812 344,81 €	0,0772%
HUTCHISON	11 907 087	519 962,97 €	0,0738%
HUTCHISON PORT HOL	7 080 700	1 698 082,31 €	0,0813%
HYPO REAL ESTAT.BK	18 977	226 585,38 €	0,0141%
HYPOPORT	15 000	2 400 000,00 €	0,2310%
HYSAN DEVELOPMENT	363 685	1 739 027,29 €	0,0348%
IBERDROLA	4 336 954	28 727 983,30 €	0,0678%
IBM	70 200	8 399 588,88 €	0,0077%
IBSTOCK PLC	1 155 793	3 910 366,55 €	0,2844%
ICADE	252 572	20 281 531,60 €	0,3389%
ID LOGISTICS	22 464	3 113 510,40 €	0,3984%
IG GROUP HOLDINGS	531 861	5 178 179,69 €	0,1442%
IHI	136 700	4 080 164,73 €	0,0884%
IIDA GROUP HOLDING	134 800	2 227 492,72 €	0,0458%
ILIAD	143 048	19 361 546,80 €	0,2424%
ILLUMINA	3 342	799 440,86 €	0,0023%
ILUKA RESOURCES	148 616	1 051 466,19 €	0,0352%
IMA INDUSTRIA	105 309	7 856 051,40 €	0,2682%
IMCD	201 740	11 600 050,00 €	0,3836%
IMERYS	116 384	8 059 592,00 €	0,1460%
IMMOFINANZ AG	11 663	237 925,20 €	0,0104%
INABA DENKISANGYO	38 800	1 359 101,23 €	0,1385%
INABATA	116 400	1 384 303,11 €	0,1833%
INCITEC PIVOT	459 749	1 056 125,09 €	0,0281%
INCYTE	18 893	1 084 177,12 €	0,0089%
INDITEX	321 489	9 406 768,14 €	0,0103%
INFINEON TECHN.	446 340	9 743 602,20 €	0,0393%
INFOGRAMES REGPT	463 314	248 336,30 €	0,1816%
ING GROEP	1 746 879	21 535 524,31 €	0,0449%
INGENICO	299 279	23 044 483,00 €	0,4740%
INNOGY SE	161 817	5 937 065,73 €	0,0308%
INPEX HOLDINGS	324 800	2 887 000,60 €	0,0222%
INSUR.AUSTRAL.GRP	369 925	1 996 873,97 €	0,0156%
INTAGE HOLDINGS IN	27 400	265 474,93 €	0,0661%
INTEGRAFIN HLDG	1 600 000	6 513 258,33 €	0,4829%
INTER PARFUMS	31 900	1 149 995,00 €	0,0742%
INTERCONTINENTALEX	121 358	7 644 966,73 €	0,0212%
INTERTEK GROUP	26 651	1 722 588,53 €	0,0165%
INTERTRUST	200 000	3 044 000,00 €	0,2174%
INTESA SA.EPAR.NCV	4 009 438	10 416 519,92 €	0,0229%
INTESA SANPAOLO	6 638 575	16 506 816,74 €	0,0379%
INTESA SANPAOLO DS	9 655 407	- €	0,0552%
INTL CONSOL.AIRL	667 106	5 017 971,33 €	0,0334%
INTRUM JUSTITIA	120 801	2 404 477,58 €	0,0918%
INTUIT	38 756	6 781 760,59 €	0,0150%
INTUITIVE SURGICAL	43 431	17 798 693,75 €	0,0382%
INVESTEC	20 412	124 177,71 €	0,0030%
INWIT	1 122 053	7 411 160,07 €	0,1870%
ION BEAM APPLICAT.	93 792	2 147 836,80 €	0,3127%
IPSEN PROMESSE	370 423	49 766 330,05 €	0,4421%
IPSOS	80 000	2 342 400,00 €	0,1798%
IRISH CONTINENTAL	643 188	3 248 099,40 €	0,3385%
IRISO ELECTR	5 300	274 172,48 €	0,0216%
ISS AS TEMP	8 069	237 498,72 €	0,0043%
ISUZU MOTORS	210 000	2 389 469,22 €	0,0248%
ITOCHU	903 600	14 026 640,13 €	0,0543%

IZUMI CO LTD	25 000	1 324 196,57 €	0,0349%
J.FRONT RETAILING	150 000	1 956 717,91 €	0,0554%
J.HARD.CHESS UNITS	197 516	2 834 870,83 €	0,0447%
JACANA MINERALS LMTD	8 609	- €	0,0000%
JACQUES BOGART	14 745	124 152,90 €	0,0941%
JACQUET METAL SCE	139 247	3 801 443,10 €	0,5795%
JARDINE CYCLE	34 717	693 925,65 €	0,0088%
JARDINE STRATEGIC	301 900	9 432 839,71 €	0,0273%
JCDECAUX	263 679	7 557 040,14 €	0,1239%
JERON.MARTINS ESC.	475 231	5 878 607,47 €	0,0755%
JGC	285 600	4 931 383,81 €	0,1102%
JOHN LAING GRP	1 087 786	3 389 990,64 €	0,2216%
JOHN WOOD CONSO	32 766	232 605,81 €	0,0048%
JOHNSON CTRLS INTL	474 669	13 599 141,84 €	0,0513%
JOHNSON ELECTRIC LTD	451 339	1 125 890,00 €	0,0514%
JOHNSON JOHNSON	264 730	27 512 601,77 €	0,0099%
JOHNSON MATTHEY PL	29 257	1 197 275,77 €	0,0151%
JPMORGAN CHASE	475 699	42 454 572,22 €	0,0142%
JSP	205 100	5 304 978,90 €	0,6529%
JSR	82 700	1 206 060,45 €	0,0366%
JTC PLC	882 211	3 830 712,09 €	0,8253%
JUMBO	214 767	3 032 510,04 €	0,1578%
JUPITER FUND MANAG	650 000	3 278 113,87 €	0,1420%
JUST EAT	819 893	7 222 215,72 €	0,1204%
JX HOLDING INC 1 SEC	2 325 700	13 850 934,82 €	0,0679%
K S HOLDINGS	100 000	890 014,75 €	0,0429%
K&S NOM	266 327	5 632 816,05 €	0,1391%
KANAMOTO	14 400	390 276,49 €	0,0399%
KANSAI PAINT	130 600	2 324 718,52 €	0,0479%
KANSAS CITY SOUTHN	24 553	2 228 286,48 €	0,0240%
KAO	36 000	2 352 237,06 €	0,0074%
KAUFMAN ET BROAD	69 687	2 813 961,06 €	0,3187%
KAWASAKI HEAVY	84 800	2 140 922,35 €	0,0508%
KBC BANCASSURANCE	173 348	11 461 769,76 €	0,0417%
KDDI	161 000	3 773 407,35 €	0,0064%
KENMARE RESOURCES	992 982	2 503 929,28 €	0,9060%
KEPPEL	257 400	1 156 072,74 €	0,0142%
KERING	111 692	54 014 251,20 €	0,0884%
KERLINK	32 511	497 418,30 €	0,6392%
KERRY GROUP CL.A	490 184	43 920 486,40 €	0,2781%
KERRY LOGISTIC	1 051 606	1 255 964,24 €	0,0619%
KERRY PROPERTIES	451 120	1 849 306,60 €	0,0310%
KESKO CL.B	243 992	12 785 180,80 €	0,3573%
KEYCORP	102 151	1 709 588,92 €	0,0097%
KEYENCE	8 500	4 111 852,66 €	0,0070%
KH NEOCHEM CO LTD	100 000	2 594 265,40 €	0,2713%
KINEPOLIS GROUP NV	53 025	2 879 257,50 €	0,1938%
KINGSPAN GROUP	460 635	19 752 028,80 €	0,2557%
KINNEVIK	11 430	335 844,96 €	0,0047%
KINTETSU WORLD EXP	110 300	1 950 579,05 €	0,1532%
KION GROUP	81 730	5 037 837,20 €	0,0692%
KITZ	150 000	1 054 331,11 €	0,1494%
KIWI PROPERTY	589 995	460 171,81 €	0,0413%
KLEPIERRE	493 154	15 904 216,50 €	0,1569%
KLINGELNBERG LTD	43 469	1 870 964,85 €	0,4917%
KLOCKNER	15 512	140 073,36 €	0,0156%
KOITO MFG	28 500	1 613 161,39 €	0,0177%
KOKUYO	75 000	1 140 742,18 €	0,0583%
KON.BAM GROEP	1 168 958	4 212 924,63 €	0,4193%
KON.BOSKALIS	221 785	5 533 535,75 €	0,1638%
KON.DSM NOM.	188 530	16 236 203,60 €	0,1039%
KON.PHILIPS ELEC.	468 407	17 061 724,98 €	0,0493%
KON.VOLKERWESSELS	133 998	2 950 635,96 €	0,1675%
KONE B	315 586	13 778 484,76 €	0,0698%
KONECRANES A	110 325	3 898 885,50 €	0,1398%
KONINK. AHOLD DELHAI	2 450 557	50 248 671,29 €	0,1965%

KONINKLIJKE KPN	5 052 528	11 772 390,24 €	0,1202%
KONINKLIJKE VOPAK	203 343	8 046 282,51 €	0,1591%
KORIAN PROMESSES	417 393	12 071 005,56 €	0,5092%
KOSE	4 700	867 505,34 €	0,0078%
KROGER	735 000	17 909 939,62 €	0,0923%
KRONES HERMANN ORD	35 000	3 874 500,00 €	0,1108%
KUBOTA	90 400	1 218 393,84 €	0,0073%
KUREHA	65 000	3 980 708,87 €	0,3124%
KYOWA EXEO	162 100	3 646 268,24 €	0,1376%
LABORATORY AMERICA	16 771	2 578 816,86 €	0,0165%
LAGARDERE	499 500	11 293 695,00 €	0,3809%
LAND SECURITIES GRP	127 541	1 380 041,65 €	0,0172%
LANXESS	6 971	465 662,80 €	0,0076%
LAR ESPANA REAL ES	314 907	3 010 510,92 €	0,3323%
LAS VEGAS SANDS	51 962	3 398 414,05 €	0,0066%
LAUDER ESTEE CL.A	30 744	3 757 322,05 €	0,0137%
LE NOBLE AGE	26 797	1 447 038,00 €	0,2761%
LEG IMMOBILIEN	158 082	14 714 272,56 €	0,2502%
LEGAL GL GROUP	281 575	846 937,86 €	0,0047%
LEGRAND PROMESSES	228 688	14 384 475,20 €	0,0855%
LEM HDG SA REGISTER	6 711	8 567 110,88 €	0,5887%
LEND LEASE	100 328	1 257 750,72 €	0,0175%
LEONI	8 997	391 369,50 €	0,0275%
LEOPALACE21	63 000	295 699,86 €	0,0249%
LI AND FUNG LTD	2 321 512	729 911,69 €	0,0273%
LINDE	81 567	14 588 257,95 €	0,5490%
LINDE AG O.N. Z.UMT.	28 273	5 779 001,20 €	0,0165%
LINEDATA SERVICES	71 343	2 511 273,60 €	0,9782%
LISI	173 696	5 636 435,20 €	0,3210%
LLOYDS BANKING GRP	455 071	1 297 919,94 €	0,0026%
LLOYDS TSB GROUP	3 497 651	2 493 660,84 €	0,0049%
L'OCCITANE INTL	1 191 702	1 683 483,41 €	0,0807%
LOEW'S	286 926	11 864 834,29 €	0,0908%
LONDON STOCK EXCH.	15 027	759 718,63 €	0,0043%
LONZA GROUP NOM.	3 589	815 717,00 €	0,0048%
LOOMIS	250 000	7 453 398,31 €	0,3479%
LOOPUP GROUP PLC	420 512	2 222 981,40 €	0,7654%
L'OREAL PF 20 N	210 356	44 490 294,00 €	0,0375%
LOWES	17 298	1 415 930,68 €	0,0021%
LULULEMON ATHLETIC	13 990	1 495 997,17 €	0,0114%
LUNDBECK	3 303	198 782,02 €	0,0017%
LUXOTTICA GROUP	233 626	12 910 172,76 €	0,0482%
LVMH MOET VUITTON	262 201	74 779 725,20 €	0,0519%
MACAU LEGEND DEVEL	1 391 000	195 895,17 €	0,0222%
MACQUARIE GROUP	26 364	2 062 972,16 €	0,0077%
MAEDA	350 000	3 447 937,23 €	0,1768%
MAGELLAN FINANCIAL	13 773	203 082,46 €	0,0078%
MAISONS DU MONDE	390 980	12 331 509,20 €	0,8642%
MAISONS FRANCE	42 000	1 789 200,00 €	0,6054%
MAKINO MILLING MACHI	100 000	666 544,49 €	0,0803%
MAN ORD.	249 872	24 225 090,40 €	0,1772%
MANI	13 000	501 106,91 €	0,0365%
MANITOU BF	39 517	1 274 423,25 €	0,0997%
MAPFRE	329 564	851 922,95 €	0,0107%
MARATHON OIL	109 822	1 962 131,75 €	0,0129%
MARATHON PETROLEUM	50 059	3 008 127,65 €	0,0111%
MARIE BRIZARD	65 000	549 900,00 €	0,2294%
MARINE HARVEST	18 567	316 474,09 €	0,0038%
MARKS SPENCER GRP	409 912	1 367 841,14 €	0,0252%
MARR	315 724	7 129 047,92 €	0,4746%
MARSHAALLS	882 946	4 073 522,56 €	0,4428%
MARUBENI	190 400	1 244 219,27 €	0,0110%
MARUI GROUP	225 000	4 060 740,61 €	0,1006%
MASTERCARD CL.A	72 345	12 176 985,48 €	0,0071%
MATCH GROUP	21 386	709 600,14 €	0,0319%
MAXIM INTEGRATED	43 141	2 167 488,38 €	0,0155%

MAZDA MOTOR	105 900	1 113 670,58 €	0,0168%
MBB	34 670	3 182 706,00 €	0,5253%
MC CARTHY AND STONE	2 511 469	2 785 945,71 €	0,4674%
MCKESSON	19 582	2 237 367,82 €	0,0098%
MEDIASET	78 080	213 939,20 €	0,0066%
MEDIAWAN	348 363	4 964 172,75 €	1,1879%
MEDIAWAN BSA	137 500	191 125,00 €	0,4689%
MEDIBANK	614 212	1 134 982,31 €	0,0223%
MEDICLINIC	156 821	933 815,11 €	0,0213%
MEDIOBANCA	432 223	3 441 359,53 €	0,0487%
MEDTRONIC HOLDINGS	240 006	17 598 315,84 €	0,0178%
MEGGITT	242 484	1 352 601,99 €	0,0312%
MEIJI HOLDINGS	108 400	7 828 851,17 €	0,0710%
MELCO CROWN ENTER	2	- €	0,0000%
MELCO INTL DEV.	444 571	1 172 101,34 €	0,0290%
MELEXIS	75 000	5 962 500,00 €	0,1856%
MELROSEINDUSTRIE PLC	234 282	563 484,83 €	0,0048%
MERCADOLIBRE	9 362	2 396 970,29 €	0,0212%
MERCIALYS	43 082	642 352,62 €	0,0468%
MERCK AND CO. NEW	704 928	36 648 648,53 €	0,0265%
MERCK KGAA	259 478	21 697 550,36 €	0,2008%
MERCURY NZ LIMITED	1 419 351	2 773 761,41 €	0,1042%
MERIDIAN ENERGY	1 723 999	3 119 184,02 €	0,0673%
MERLIN ENTERTAINMENT	865 082	3 782 746,75 €	0,0846%
MERLIN PROPERTIES	550 000	6 850 250,00 €	0,1171%
MERSEN	96 427	3 288 160,70 €	0,4673%
METHANEX CORP	34 200	2 070 951,99 €	0,0430%
METRO AG	77 571	821 089,04 €	0,0215%
METROPOLE TV	95 274	1 632 043,62 €	0,0754%
METSO	292 479	8 394 147,30 €	0,1945%
MGM CHINA HOLDINGS	404 314	803 335,70 €	0,0106%
MICHELIN	289 359	30 180 143,70 €	0,1617%
MICRO FOCUS INTL	20 661	309 208,28 €	0,0048%
MICROSOFT	601 657	50 815 294,23 €	0,0078%
MINTH GROUP	206 000	745 517,17 €	0,0180%
MIRAI INDUSTRY	59 200	1 044 622,14 €	0,2312%
MIRVAC GROUP	2 326 703	3 195 130,69 €	0,0626%
MITSUB UF J FINA GP	2 438 100	11 897 934,49 €	0,0176%
MITSUB.ELECTRIC	575 000	6 555 932,90 €	0,0268%
MITSUBISHI	551 200	13 118 968,92 €	0,0347%
MITSUBISHI GAS	100 000	1 940 866,21 €	0,0432%
MITSUBOSHI BELTING	133 000	1 431 570,55 €	0,2040%
MITSUI	153 200	2 188 593,43 €	0,0088%
MITSUI CHEMICALS	150 000	3 421 646,61 €	0,0733%
MITSUI MINING	70 000	2 552 123,08 €	0,1222%
MIURA	87 200	1 815 828,03 €	0,0696%
MOBILEONE	990 060	995 066,43 €	0,1070%
MONCLER SPA	560 246	21 849 594,00 €	0,2190%
MONDELEZ INTL	444 900	15 623 228,13 €	0,0303%
MONDI	66 452	1 541 166,42 €	0,0181%
MONSTER BEVERAGE	39 663	1 946 546,10 €	0,0072%
MORGAN CRUCIBLE	762 901	2 817 475,74 €	0,2673%
MORGAN STANLEY	131 372	5 333 418,53 €	0,0075%
MORI SEIKI	175 000	2 079 858,53 €	0,1389%
MORITA	57 800	999 358,97 €	0,1232%
MOTOROLA SOLTN-ED	140 000	13 953 834,95 €	0,0863%
MPC CONTAINER SHIP	524 353	3 003 072,56 €	0,6224%
MTR	885 028	4 193 277,82 €	0,0145%
MTU AERO ENGINES	117 773	19 385 435,80 €	0,2265%
MUNCHENER RUCKVERS	122 730	22 220 266,50 €	0,0821%
MURATA MFG	124 000	17 853 494,76 €	0,0550%
MUSASHI SEIMITSU I	129 900	3 681 332,19 €	0,4158%
MUSASHINO BANK	72 200	1 836 770,83 €	0,2136%
NABALTEC	81 277	1 771 838,60 €	0,9236%
NAFCO	150 800	2 151 392,20 €	0,5063%
NAKANISHI	338 800	6 588 753,65 €	0,3594%

NAT.AUSTRALIA BANK	287 171	4 981 241,05 €	0,0105%
NATIONAL GRID RG	95 998	910 100,33 €	0,0028%
NATIXIS	2 151 532	13 077 011,49 €	0,0683%
NATUREX	22 561	3 041 222,80 €	0,2344%
NCC GROUP PLC	3 000 000	6 947 475,55 €	1,0804%
NEOPOST	13 959	321 336,18 €	0,0404%
NESTE OY	706 763	47 494 473,60 €	0,2756%
NESTLE NOM.	170 146	11 285 830,34 €	0,0056%
NETAPP	54 987	3 698 453,27 €	0,0212%
NETFLIX INC	39 146	13 123 993,65 €	0,0090%
NEURONES	124 446	2 986 704,00 €	0,5124%
NEW WORLD DEV.	1 364 807	1 644 929,21 €	0,0134%
NEWCREST MING	262 805	3 625 584,74 €	0,0342%
NEXANS	273 491	8 076 189,23 €	0,6272%
NEXITY	164 125	8 879 162,50 €	0,2924%
NEXON CO LTD	863 500	10 743 363,35 €	0,0968%
NEXT GROUP	6 621	452 954,71 €	0,0047%
NEXTEER AUTOMOTIVE	229 000	290 001,58 €	0,0091%
NEXTERA ENERGY INC	39 100	5 593 655,95 €	0,0083%
NEXUS	115 529	3 177 047,50 €	0,7334%
NFON AG	145 484	1 964 761,42 €	1,0537%
NGK INSULATORS	54 300	828 416,60 €	0,0166%
NIDEC	29 600	3 805 180,33 €	0,0099%
NIFCO	110 800	2 938 703,42 €	0,1031%
NIKE CL.B	54 066	3 689 759,65 €	0,0042%
NINTENDO	10 700	2 995 120,00 €	0,0076%
NIP.SUISAN KAISHA	254 000	1 072 378,84 €	0,0813%
NIPPON LIGHT METAL	800 000	1 540 320,92 €	0,1290%
NIPPON SEIKI	164 100	2 646 944,06 €	0,2694%
NIPPON TELEG.TEL.	250 000	9 735 261,21 €	0,0119%
NISHIO RENT ALL	114 300	3 142 011,09 €	0,4026%
NISSHIN FUDOSAN	408 100	2 177 396,72 €	0,8692%
NITTA CORP	112 800	3 794 200,14 €	0,3726%
NN GROUP N.V.	957 774	33 368 846,16 €	0,2808%
NOBLE GROUP	3 571 761	302 891,26 €	0,2691%
NOHMI BOSAI	90 000	1 648 653,73 €	0,1479%
NOKIA	3 030 067	14 938 230,31 €	0,0538%
NOKIAN RENKAAT	211 512	7 157 566,08 €	0,1532%
NOMURA HOLDINGS	490 300	2 040 457,09 €	0,0135%
NORDEA BANK	146 634	1 211 268,80 €	0,0036%
NORMA GROUP AG	82 638	4 854 982,50 €	0,2594%
NORTHROP GRUMMAN	49 786	13 120 767,59 €	0,0286%
NOVARTIS	107 837	7 002 173,08 €	0,0042%
NOVARTIS ADR	27 090	1 752 711,75 €	0,0011%
NOVO NORDISK AS	86 477	3 435 541,90 €	0,0045%
NOVOZYMES B NV	38 249	1 661 750,08 €	0,0157%
NTT DOCOMO	32 700	713 680,09 €	0,0009%
NUFARM	365 787	2 050 925,72 €	0,1116%
NUTRIEN	30 735	1 431 518,39 €	0,0050%
NVIDIA	25 203	5 113 777,31 €	0,0041%
NWS HOLDINGS	1 704 000	2 526 249,60 €	0,0437%
NXP SEMICONDUCTORS	14 783	1 383 528,25 €	0,0043%
OAKLEY CAPITAL INV	1 490 592	3 109 789,38 €	0,0000%
OBARA GROUP INC	37 600	1 837 497,69 €	0,1802%
OBIC	10 400	737 436,37 €	0,0104%
OBRASCON HUARTE	89 024	244 014,78 €	0,0311%
OC OERLIKON CORP.	176 420	2 311 484,71 €	0,0519%
OCCIDENTAL PETROL.	225 530	16 164 061,84 €	0,0295%
OENEO	63 799	648 197,84 €	0,0995%
OIL SEARCH	496 940	2 798 864,70 €	0,0326%
OKINAWA CELLULAR	148 700	5 105 235,93 €	0,5439%
OMRON	43 400	1 735 010,67 €	0,0203%
OMV	258 889	12 574 238,73 €	0,0791%
ON THE BEACH GROUP	344 325	1 954 555,89 €	0,2628%
ONCIMMUNE HOLDINGS	543 674	783 834,85 €	0,8822%
ONO PHARMACEUTICAL	136 800	2 747 134,52 €	0,0252%

OPEN HOUSE CO	80 000	4 058 034,22 €	0,1391%
OPHIR ENERGY PLC	1 308 874	747 420,56 €	0,1851%
ORACLE	361 274	13 633 448,19 €	0,0091%
ORANGE	3 173 745	45 527 372,03 €	0,1193%
OREAL	63 350	13 398 525,00 €	0,0113%
ORICA	286 977	3 223 542,43 €	0,0757%
ORIENT OVERSEAS	249 500	2 080 993,89 €	0,0399%
ORIGIN ENERGY	84 352	535 407,26 €	0,0048%
ORIGIN ENTERPRISES	536 395	3 309 557,15 €	0,4271%
ORION CL.B	382 342	8 828 276,78 €	0,3672%
ORIX	1 088 800	14 750 410,01 €	0,0822%
ORKLA S.A	38 542	289 186,51 €	0,0038%
ORORA LTD	1 006 541	2 273 985,17 €	0,0834%
ORPEA	286 979	32 801 699,70 €	0,4443%
ORSTED	9 149	473 984,19 €	0,0022%
OSRAM LICHT AG	82 816	2 898 560,00 €	0,0791%
OTSUKA	25 200	846 666,16 €	0,0265%
OUTOKUMPU CL.A	44 633	237 804,62 €	0,0107%
OVERS.CHINESE BKG	257 700	1 884 247,62 €	0,0062%
OVS	685 387	1 916 342,05 €	0,3019%
OW BUNKER AS	41 498	- €	0,1129%
OWENS CORNING	13 683	742 659,17 €	0,0123%
OZ MINERALS	197 907	1 179 777,21 €	0,0613%
PACIFIC INDUSTRIAL	75 000	944 142,49 €	0,1224%
PACIFIC METALS	44 900	1 414 802,55 €	0,2293%
PAL	14 900	301 747,48 €	0,0644%
PALTAC	16 000	789 337,14 €	0,0252%
PANASONIC	300 000	3 464 562,18 €	0,0122%
PARGESA HOLDING	1 642	119 111,74 €	0,0021%
PARROT PROMESSES	21 000	118 440,00 €	0,0696%
PAYPAM HOLDING INC	167 323	11 933 524,23 €	0,0141%
PCCW	6 341 369	3 059 934,93 €	0,0821%
PEARSON	153 391	1 535 037,43 €	0,0196%
PERNOD-RICARD	283 217	39 622 058,30 €	0,1067%
PERPETUAL	8 786	231 298,32 €	0,0189%
PERSIMMON	14 580	417 607,73 €	0,0046%
PEUGEOT S.A.	1 075 941	21 045 405,96 €	0,1189%
PFIZER	709 879	22 058 507,23 €	0,0121%
PHILIPS LIGHTING	10 018	222 900,50 €	0,0073%
PHILLIPS 66	158 515	15 248 014,77 €	0,0341%
PIERRE VACANCES	20 000	587 000,00 €	0,2040%
PINGUELY HAULOTTE	61 472	899 950,08 €	0,1959%
PIOLAX	115 000	2 372 496,30 €	0,2930%
PIRELLI & C	109 471	782 936,59 €	0,0109%
PLASTIC OMNIUM	386 867	14 008 454,07 €	0,2581%
PLASTIQUES DU VAL	53 809	818 972,98 €	0,2432%
PLATINUM AM	109 638	399 642,37 €	0,0187%
PNC FIN.SCES GROUP	133 500	15 447 603,96 €	0,0288%
PORR AG	99 468	2 864 678,40 €	0,3419%
PORSHE AUTOMOBILE	216 452	11 809 621,12 €	0,1414%
POSTE ITALIANE	1 092 245	7 831 396,65 €	0,0836%
POSTNL NV	46 257	148 716,26 €	0,0099%
POXEL SA	96 379	697 783,96 €	0,3727%
PRADA	255 625	1 013 017,27 €	0,0100%
PRAXAIR	61 497	8 330 050,58 €	0,0214%
PREMIER OIL	1 736 824	2 527 610,66 €	0,2129%
PRIMA MEAT PACKERS	870 000	4 312 202,64 €	0,3444%
PROACTIS HOLDING	1 930 046	2 782 618,48 €	2,0418%
PROCTER GAMBLE	70 200	4 693 428,12 €	0,0028%
PROSEGUR CASH S.A.	2 250 000	5 197 500,00 €	0,1500%
PROSIEBEN NOM.	159 005	3 455 178,65 €	0,0682%
PROTO	16 400	184 006,49 €	0,0783%
PROXIMUS	429 499	8 293 625,69 €	0,1271%
PRUDENTIAL	42 538	834 309,50 €	0,0016%
PRYSMIAN	139 749	2 980 846,17 €	0,0521%
PUBLICIS GROUPE	379 120	22 345 332,80 €	0,1612%

PUMA R.RUDOLF ECH.	22 477	11 260 977,00 €	0,1490%
QANTAS AIRWAYS	288 329	1 123 975,85 €	0,0171%
QBE INS.GROUP	239 946	1 478 973,57 €	0,0178%
QIAGEN N.V	309 746	9 664 075,20 €	0,1364%
QUALCOMM	244 500	11 752 250,44 €	0,0166%
RAIFFEIS.INTL BK	432 638	11 374 053,02 €	0,1315%
RAMSAY HEALTH CARE	83 976	2 868 639,72 €	0,0416%
RANDGOLD RESOURCES	3 383	222 638,77 €	0,0036%
RANDSTAD PROV.DIV.	97 876	4 934 907,92 €	0,0534%
RATHBONE BROTHERS	143 175	4 199 648,89 €	0,2595%
RATIONAL	26 611	14 875 549,00 €	0,2340%
RAYSEARCH LABS B	250 000	2 513 188,25 €	0,9679%
REAL GOLD MINING LTD	90 500	- €	0,0100%
REALESTATE.COM.AU	23 540	1 353 676,62 €	0,0179%
RECKITT BENCKISER	32 102	2 264 763,70 €	0,0045%
RECORDATI IND.CHI.	406 476	13 844 572,56 €	0,1944%
RECRUIT HOLDINGS	159 700	3 786 159,85 €	0,0094%
RED ELECTRICA CORPOR	1 222 874	21 326 922,56 €	0,2260%
RED HAT	41 419	4 766 794,60 €	0,0234%
REGENERON PHARM.	317	93 667,79 €	0,0003%
REGENERESIS	572 378	485 422,63 €	0,8945%
REGIONS FINANCIAL	367 337	5 593 980,44 €	0,0333%
RELO HOLDINGS	87 300	1 973 847,02 €	0,0571%
RELX N.V.	763 666	13 948 359,50 €	0,0763%
RELX PLC	51 393	942 897,53 €	0,0026%
REMY COINTREAU	88 348	9 806 628,00 €	0,1734%
RENAULT	527 380	38 409 085,40 €	0,1783%
RENESAS ELECTRO	382 500	3 212 056,26 €	0,0229%
RENISHAW PLC	196 730	11 790 230,11 €	0,2703%
RENTOKIL INITIAL	1 144 250	4 538 959,69 €	0,0621%
REPSOL S.A. DO18	859 801	417 949,26 €	0,0539%
REPSOL YPF	859 801	14 414 563,77 €	0,0539%
RESONA HOLDINGS	800 200	3 666 756,52 €	0,0344%
RESTAURANT BRANDS	52 500	2 711 447,05 €	0,0210%
REXEL PROMESSES	1 639 527	20 190 775,01 €	0,5393%
REZIDOR HOTEL	898 977	2 474 469,72 €	0,5155%
RHEINMETALL ORD.	2 660	251 529,60 €	0,0061%
RIGHTMOVE	200 000	12 008 820,04 €	0,0222%
RINNAI	15 300	1 155 867,02 €	0,0296%
RIO TINTO	1 138	60 090,32 €	0,0003%
RIO TINTO PLC	26 942	1 280 238,24 €	0,0021%
RIZAP GROUP	36 800	456 145,32 €	0,0066%
RM2 INTERNATIONAL	2 319 568	26 229,07 €	0,0478%
ROBERTET	8 510	4 289 040,00 €	0,3937%
ROCHE HOLDING BJ	34 061	6 479 625,26 €	0,0048%
ROCKWELL AUTOMAT.	9 810	1 396 699,33 €	0,0080%
ROHM	7 200	517 770,52 €	0,0065%
ROLLS ROYCE HLDG PLC	6 176 716	6 984,47 €	0,3304%
ROLLS ROYCE HOLDIN	10 171	113 653,89 €	0,0005%
ROPER TECHNOLOGIES	14 507	3 428 226,95 €	0,0140%
ROSS STORES	100 470	7 292 906,08 €	0,0269%
ROTHSCHILD & CO	42 246	1 223 021,70 €	0,0545%
ROYAL BK SCOT. GRP	526 348	1 524 257,62 €	0,0044%
ROYAL DUTCH SHELL	159 841	4 751 761,06 €	0,0035%
ROYAL DUTCH SHELL	180 934	5 551 697,96 €	0,0048%
ROYAL DUTCH SHELL	91 788	5 442 579,11 €	0,0040%
ROYAL MAIL PLC	87 141	498 004,87 €	0,0087%
ROYAL UNIBREW	102 261	6 979 172,23 €	0,2005%
RPS GROUP PLC	1 852 810	5 353 004,53 €	0,8212%
RTL GROUP	159 107	9 307 759,50 €	0,1028%
RUBIS	467 576	25 015 316,00 €	0,4830%
RWE	19 772	386 048,30 €	0,0034%
RYANAIR HOLDINGS	18 116	286 323,38 €	0,0016%
RYMAN HEALTHCARE G	37 273	258 724,70 €	0,0075%
RYOHIN KEIKAKU	2 100	633 294,59 €	0,0075%
S AND P GLOBAL INC.	28 196	4 923 885,44 €	0,0112%



SA SA INTERNATIONAL	2 091 209	1 136 929,88 €	0,0688%
SAFESTORE HOLDING	415 583	2 582 267,87 €	0,1979%
SAFRAN	350 294	36 448 090,70 €	0,0840%
SAINSBURY	77 534	281 607,07 €	0,0035%
SAINT MARC HOLDINGS	60 300	1 274 787,22 €	0,2647%
SAINT-GOBAIN	611 631	23 407 118,37 €	0,1107%
SAIPEM	742 223	2 927 327,51 €	0,0734%
SAKATA INKS	16 000	179 023,64 €	0,0256%
SAKATA SEED	8 900	288 353,95 €	0,0184%
SALESFORCE.COM	108 277	12 649 550,59 €	0,0143%
SALVATORE FERRAGAM	238 097	4 976 227,30 €	0,1411%
SALZGITTER	5 642	210 728,70 €	0,0094%
SAMPO A	239 134	9 995 801,20 €	0,0432%
SAMSONITE INTL SA	518 290	1 570 155,68 €	0,0362%
SAN A	44 100	1 865 296,15 €	0,1379%
SAN.AV.ADR SPONS.	205 500	7 042 143,81 €	0,0082%
SANDS CHINA	353 142	1 617 291,24 €	0,0044%
SANDVIK	132 992	2 024 502,68 €	0,0106%
SANKYU	84 000	3 780 281,57 €	0,1288%
SANOFI AVENTIS	1 788 005	122 746 543,25 €	0,1429%
SANTOS	145 744	578 290,65 €	0,0070%
SAP SYSTEME ORD.	379 543	37 555 779,85 €	0,0309%
SARTORIUS PRIV.	83 507	10 697 246,70 €	0,2230%
SARTORIUS STEDIM BIO	346 737	31 032 961,50 €	0,3762%
SATO HOLDINGS	41 700	1 068 910,80 €	0,1194%
SAVANNAH PETROLEUM	4 633 082	1 527 159,38 €	0,5671%
SBI	447 200	9 869 102,11 €	0,1991%
SBM OFFSHORE	266 411	3 549 926,58 €	0,1295%
SCANDI STANDARD	608 950	3 340 657,64 €	0,9218%
SCHAEFFLER PREF.	8 127	90 616,05 €	0,0049%
SCHEIN HENRY	247 000	15 367 290,48 €	0,1613%
SCHIBSTED CLASS A	134 364	3 496 062,04 €	0,1244%
SCHIBSTED CLASS B	144 602	3 495 004,20 €	0,1106%
SCHINDLER HOLD.BP	1 926	354 848,49 €	0,0047%
SCHINDLER HOLD.NOM	952	171 456,07 €	0,0014%
SCHLUMBERGER ORD	340 822	19 566 869,65 €	0,0246%
SCHNEIDER ELECTRIC	945 719	67 543 250,98 €	0,1633%
SCHOELLER BLECKM.	31 687	3 273 267,10 €	0,1980%
SCHWAB CHARLES	292 738	12 812 223,72 €	0,0217%
SCOR REGPT	599 312	19 070 107,84 €	0,3114%
SCOTT.SOUTH.ENERGY	49 443	757 565,05 €	0,0049%
SCOUT 24	148 277	6 737 706,88 €	0,1378%
SEB	135 073	20 206 920,80 €	0,2692%
SEB PRIM FID 2020	42 819	6 405 722,40 €	0,0000%
SEEK	35 560	490 800,91 €	0,0101%
SEGRO NV09	47 843	362 142,86 €	0,0047%
SEIBU HOLDINGS INC	45 000	649 996,87 €	0,0132%
SEKISUI CHEMICAL	88 500	1 292 013,76 €	0,0180%
SEMBCORP MARINE	273 597	350 600,13 €	0,0131%
SEMICONDUCTOR MANUF	1 437 800	1 601 052,41 €	0,0285%
SEMPRA ENERGY	27 895	2 774 089,72 €	0,0102%
SERIA	11 000	452 507,93 €	0,0145%
SERVICENOW	57 520	8 496 830,46 €	0,0323%
Serviceware SE	86 257	2 027 470,79 €	0,8415%
SES GLOBAL FDR	1 287 800	20 205 582,00 €	0,3358%
SEVERN TRENT	11 487	257 121,24 €	0,0048%
SGS NOM.	265	603 898,74 €	0,0035%
SHAFTESBURY	907 387	9 598 694,40 €	0,2953%
SHANGRI LA ASIA	690 269	1 112 273,59 €	0,0193%
SHERWIN-WILLIAMS	5 589	1 951 016,00 €	0,0060%
SHIKOKU CHEMICALS	204 000	2 440 295,17 €	0,3461%
SHIMA SEIKI MFG	11 700	478 589,77 €	0,0320%
SHIMANO	11 800	1 483 625,97 €	0,0127%
SHIN-ETSU CHEMICAL	106 600	8 138 197,41 €	0,0249%
SHINSEI BANK	101 200	1 335 000,47 €	0,0391%
SHIONOGI	117 200	5 157 486,21 €	0,0362%

SHIRE	42 582	2 053 623,90 €	0,0047%
SHOP APOTHEKE EUR	61 957	2 757 086,50 €	0,5131%
SHOIFY A	19 776	2 471 089,58 €	0,0211%
SHOWA DENKO KK	115 000	4 375 068,14 €	0,0768%
SHUI ON LAND	4 123 721	895 878,78 €	0,0511%
SHUN TAK HOLDINGS	712 474	249 678,39 €	0,0235%
SIA ENGINEERING	423 730	835 775,12 €	0,0379%
SIEMENS	408 254	46 222 517,88 €	0,0480%
SIEMENS HEALTHIN	7 257	256 571,24 €	0,0007%
SIIX	147 800	2 776 027,91 €	0,2933%
SIKA AG	79 440	9 414 806,57 €	0,0560%
SIMCORP	210 692	14 619 802,70 €	0,5202%
SIMPLYBIZ GROUP	1 646 461	3 366 834,48 €	2,1531%
SIMS	286 016	2 910 477,96 €	0,1400%
SINGAPORE AIRLINES	197 600	1 326 890,92 €	0,0167%
SINGAPORE AIRPORT	490 507	1 540 585,45 €	0,0439%
SINGAPORE EXCHANGE	389 757	1 755 430,57 €	0,0364%
SINGAPORE POST	2 015 520	1 595 248,09 €	0,0892%
SINGAPORE PRESS	1 387 105	2 265 443,64 €	0,0868%
SINGAPORE TECHN.	478 900	989 717,64 €	0,0154%
SINGAPORE TELECOM.	1 482 325	2 867 904,77 €	0,0091%
SINO LAND	755 922	1 053 015,00 €	0,0114%
SINTOKOGIO	12 100	91 973,09 €	0,0222%
SJM HLDGS LTD	1 367 749	1 457 347,50 €	0,0242%
SK KAKEN	25 000	2 020 124,69 €	0,1595%
SKANDINAV. ENSK.A	180 510	1 471 745,22 €	0,0083%
SKANSKA S.B	16 424	255 993,57 €	0,0041%
SKF S.B LIBRE	18 784	299 791,55 €	0,0045%
SKY CITY ENTERT.	73 719	172 707,10 €	0,0108%
SL GREEN REALTY	25 457	2 191 933,72 €	0,0294%
SLIGRO FOOD GROUP	87 071	3 909 487,90 €	0,1967%
SMC	29 500	9 268 100,12 €	0,0438%
SMCP SAS	143 273	3 507 323,04 €	0,1924%
SMITH NEPHEW	42 883	677 903,93 €	0,0049%
SMITH(DS)	822 101	4 845 129,65 €	0,0601%
SMITHS GROUP	19 406	372 605,73 €	0,0049%
SMS CO	18 400	287 829,69 €	0,0212%
SMURFIT KAPPA GP	22 230	771 381,00 €	0,0094%
SNAM RETE GAS	7 494 552	26 800 517,95 €	0,2160%
SOCIETE GENERALE A	1 631 491	58 921 297,48 €	0,2019%
SOCIETE LDC	13 029	1 719 828,00 €	0,0768%
SODEXHO ALLIANCE	173 468	14 852 330,16 €	0,1176%
SODEXO PF 2020	10 000	856 200,00 €	0,0000%
SODEXO PRI FID 2019	41 800	3 578 916,00 €	0,0000%
SODEXO PRIME	79 083	6 771 086,46 €	0,0000%
SOFTBANK	118 900	7 330 363,27 €	0,0108%
SOITEC SA	55 167	3 983 057,40 €	0,1744%
SOLOCAL GROUPE	880 000	962 720,00 €	0,1508%
SOLUTIONS 30	62 240	2 576 736,00 €	0,2574%
SOLVAY	5 132	555 025,80 €	0,0048%
SOMFY NV	67 048	5 330 316,00 €	0,1812%
SOMPO HOLDING	225 000	7 794 394,99 €	0,0542%
SONIC HEALTHCARE	206 107	3 199 471,40 €	0,0484%
SONOVA HOLDING NOM	2 522	386 887,22 €	0,0039%
SOPHOS GROUP	649 878	4 695 788,34 €	0,1362%
SOPRA GROUP	81 432	14 218 027,20 €	0,3963%
SOUTHWEST AIRLINES	286 535	12 486 746,43 €	0,0500%
SPARK NEW ZEALAND	475 507	1 028 525,68 €	0,0259%
SPECTRIS	161 383	4 762 929,04 €	0,1397%
SPIE	535 000	9 298 300,00 €	0,3439%
SPIRAX-SARCO ENG PLC	55 647	4 102 656,64 €	0,0756%
SPIRIT AEROSYSTEMS	21 098	1 552 421,04 €	0,0198%
SQUARE CL A	31 027	1 638 049,15 €	0,0103%
SRA HOLDINGS	25 100	593 905,06 €	0,1647%
SRP GROUP	118 000	855 500,00 €	0,3408%
ST. JAMES S PLACE	1 165 481	15 122 852,35 €	0,2202%

STABILUS GMBH	71 961	5 544 595,05 €	0,2913%
STANDARD CHARTERED	190 314	1 490 489,92 €	0,0058%
STANDARD LIFE BK PLC	141 509	521 167,87 €	0,0048%
STANLEY BLACK DECKER	98 345	11 186 843,78 €	0,0643%
STARHUB	1 158 142	1 207 648,31 €	0,0669%
STARTS	221 900	4 634 509,37 €	0,4109%
STATE STREET	209 537	16 706 607,28 €	0,0552%
STATOILHYDRO	53 567	1 218 148,26 €	0,0016%
STEEL DYNAMICS	65 752	2 587 730,20 €	0,0280%
STEF TFE	42 799	4 416 856,80 €	0,3251%
STEMMER IMAGING AG	48 806	2 019 592,28 €	0,7509%
STMICROELECTRONICS	1 770 749	33 839 013,39 €	0,1943%
STOCKLAND	1 468 373	3 689 052,53 €	0,0603%
STORA ENSO S.R	1 764 082	29 566 014,32 €	0,2881%
STRADA ARZNEIMITTEL	44 784	3 602 424,96 €	0,0718%
STRATEC BIOMEDICAL	90 571	6 059 199,90 €	0,7571%
STRAUMANN HOLDING	456	296 959,50 €	0,0029%
STRYKER	51 577	7 459 459,74 €	0,0138%
SUDZUCKER	416 726	5 684 142,64 €	0,2041%
SUEZ ENVIRON.COMP.	1 381 316	15 339 514,18 €	0,2223%
SUMCO	180 000	3 113 582,43 €	0,0614%
SUMI MITSUI FIN GP	635 700	21 166 454,41 €	0,0454%
SUMI MITSUI TRU HLG	97 800	3 322 170,65 €	0,0251%
SUMITOMO	122 100	1 718 339,33 €	0,0098%
SUMITOMO REALTY	30 000	948 550,03 €	0,0063%
SUMITOMO FORESTRY	244 600	3 171 840,89 €	0,1339%
SUMITOMO METAL	30 000	983 114,46 €	0,0103%
SUMMIT INTERNAT	1 149 116	- €	0,0140%
SUN ART RETAIL GRO	1 672 500	1 873 356,30 €	0,0175%
SUN FRONT.FUDOSAN	200 000	2 027 470,60 €	0,4102%
SUN HUNG KAI PROP.	203 929	2 635 952,55 €	0,0070%
SUNCORP GROUP	187 556	1 731 706,14 €	0,0144%
SURUGA BANK	144 800	1 109 593,99 €	0,0624%
SUZUKI MOTOR	184 210	8 714 541,73 €	0,0375%
SVB FINANCIAL GROUP	7 042	1 741 636,69 €	0,0132%
SVENSKA HANDEL FONDE	65 903	628 182,43 €	0,0035%
SWATCH GROUP NOM.	2 675	198 084,06 €	0,0022%
SWEDBANK A	44 203	811 700,96 €	0,0039%
SWIRE PACIFIC CL.A	176 500	1 601 225,99 €	0,0195%
SWIRE PACIFIC CL.B	1 035 000	1 577 366,69 €	0,0347%
SWIRE PROPERTIES	847 526	2 683 230,15 €	0,0145%
SWISS LIFE HO.NOM.	1 571	467 499,03 €	0,0046%
SWISS PRIME SITE	3 490	274 389,53 €	0,0049%
SWISS RE	27 884	2 061 205,68 €	0,0082%
SWISSCOM NOM.	4 199	1 605 207,06 €	0,0081%
SWORD GROUP	107 350	3 810 925,00 €	1,1247%
SYDNEY AIRPORT UNITS	527 311	2 389 284,12 €	0,0234%
SYMRISE	196 266	14 739 576,60 €	0,1512%
SYNCHRONY FCIAL	499 600	14 283 455,10 €	0,0675%
SYNERGIE	120 872	5 100 798,40 €	0,4961%
SYNTHOMER	637 811	3 800 829,95 €	0,1877%
SYSMEX	9 400	751 571,44 €	0,0045%
T AND D	456 000	5 869 086,64 €	0,0696%
T&K TOKA	152 900	1 410 489,34 €	0,6102%
TABCORP HOLDINGS	863 506	2 437 183,12 €	0,0428%
TAIYO INK MFG	53 800	1 892 847,17 €	0,1864%
TAKAMATSU	55 100	1 416 658,35 €	0,1417%
TAKEAWAY.COM B.V.	208 377	11 919 164,40 €	0,4822%
TAKKT	183 967	2 880 923,22 €	0,2804%
TALANX AG	192 219	6 012 610,32 €	0,0760%
TARGET	173 103	11 285 684,00 €	0,0329%
TARKETT SA	445 099	10 985 043,32 €	0,6985%
TAYLOR WIMPEY	154 360	312 263,29 €	0,0047%
TD AMERITRADE HLDG	90 107	4 226 937,09 €	0,0159%
TDK	117 700	10 302 550,89 €	0,0908%
TE CONNECTIVITY LTD	49 831	3 843 758,18 €	0,0143%

TEAM17 GROUP	1 103 062	2 987 316,66 €	0,8402%
TECHNICOLOR	1 000 000	1 054 000,00 €	0,2413%
TECHNIPFMC P.L.C.	1 233 826	33 745 141,10 €	0,2715%
TECHNO ASSOCIE	16 900	173 150,78 €	0,0843%
TECHNOGYM SPA	360 374	3 657 796,10 €	0,1793%
TECHTRONIC INDUST.	591 570	2 825 472,57 €	0,0323%
TED BAKER	107 128	2 609 303,01 €	0,2404%
TEIKOKU SEN I	37 500	671 570,64 €	0,1378%
TEL.ERICSSON S.B	328 013	2 175 050,06 €	0,0107%
TELE COLUMBUS	946 269	5 630 300,55 €	0,7418%
TELE2 AB-B	17 102	172 413,39 €	0,0035%
TELECOM ITAL.EPAR.	14 622 351	8 182 667,62 €	0,2426%
TELECOM ITAL.ORD.	12 530 188	7 986 741,83 €	0,0824%
TELEFONICA	2 859 606	20 815 072,08 €	0,0551%
TELEFONICA DEUTSCH	2 875 166	9 706 560,42 €	0,0967%
TELEKOM AUSTRIA	813 373	5 807 483,22 €	0,1224%
TELENET GROUP HOLD	214 530	8 581 200,00 €	0,1824%
TELENOR	96 502	1 695 072,44 €	0,0066%
TELEPERFORMANCE	302 165	45 717 564,50 €	0,5230%
TELEPIZZA GROUP	694 669	4 022 133,51 €	0,6897%
TELSTRA	2 201 429	3 650 008,85 €	0,0185%
TENARIS	841 246	13 220 180,89 €	0,0713%
TERNA	5 157 809	23 890 971,29 €	0,2566%
TERUMO	5 900	289 699,41 €	0,0016%
TESCO	472 143	1 370 488,02 €	0,0048%
TESLA MOTORS	22 901	6 726 819,37 €	0,0134%
TESSI	16 831	3 214 721,00 €	0,6016%
TF1	153 448	1 385 635,44 €	0,0731%
THALES	214 304	23 648 446,40 €	0,1006%
THE LINK REIT	324 792	2 540 553,91 €	0,0154%
THE STAR ENTER GP	382 674	1 193 888,63 €	0,0417%
THERMO FISHER	4 521	802 089,79 €	0,0011%
THULE GROUP AB	373 707	7 971 538,23 €	0,3621%
THYSSENKRUPP	272 302	5 669 327,64 €	0,0437%
TINGYI HOLDING	1 271 833	2 527 018,23 €	0,0226%
TJX COS	14 889	1 213 768,16 €	0,0024%
TOCALO	94 400	846 013,53 €	0,1494%
TOKAI CARBON	60 000	923 728,60 €	0,0267%
TOKAI CORP	55 900	1 031 777,62 €	0,1551%
TOKAI TOKYO SECU.	470 700	2 576 910,50 €	0,1740%
TOKIO MARINE HOLD.	449 000	18 029 618,70 €	0,0600%
TOKYO ELECTRON	16 200	2 382 579,53 €	0,0098%
TOKYO SEIMITSU	115 300	3 267 571,99 €	0,2773%
TOKYO STEEL MFG	498 000	3 789 189,45 €	0,3212%
TOKYU FUDOSAN HOLD	500 000	3 023 421,07 €	0,0780%
TOMOKU	60 200	948 220,63 €	0,3112%
TOMRA SYSTEMS	85 700	1 540 006,31 €	0,0579%
TOMTOM	571 000	4 429 818,00 €	0,2426%
TOPCON	40 400	593 549,36 €	0,0374%
TOPRE	292 700	6 312 379,72 €	0,5418%
TOTAL FINA	2 440 007	127 392 765,47 €	0,0915%
TOWNGAS CHINA	3 017 476	2 506 890,58 €	0,1074%
TOYOTA INDUSTRIES	119 300	5 728 671,54 €	0,0366%
TOYOTA MOTOR	95 300	5 283 648,70 €	0,0029%
TPR CO LTD	108 200	2 159 420,12 €	0,2997%
TRANSURBAN UNIT	405 631	3 072 650,97 €	0,0158%
TRAVIS PERKINS	20 617	331 629,82 €	0,0082%
TREASURY WINE EST	205 174	2 257 926,76 €	0,0285%
TREEHOUSE FOODS	188 900	8 495 686,69 €	0,3359%
TREND MICRO	45 200	2 208 906,80 €	0,0322%
TRIGANO	18 690	2 844 618,00 €	0,0967%
TRYGVESTA A/S NV	118 220	2 376 871,43 €	0,0391%
TSUBAKI NAKASHIMA	64 900	1 310 308,16 €	0,1605%
TSUBAKIMOTO CHAIN	150 000	1 020 694,58 €	0,0784%
TSUKADA GLOBAL HOL	127 000	628 500,42 €	0,2594%
TSURUHA	9 400	1 009 606,13 €	0,0191%

TUI NOM.	48 008	902 508,06 €	0,0082%
TV BROADCASTS	579 159	1 571 198,66 €	0,1322%
TWITTER	41 979	1 570 145,12 €	0,0055%
TYMAN	735 169	2 739 166,46 €	0,3746%
TYSON FOODS CL.A	97 400	5 743 642,67 €	0,0329%
U S BANCORP	755 592	32 370 957,85 €	0,0464%
UBI BANCA	1 501 881	4 944 192,25 €	0,1313%
UBI SOFT ENTERTAIN	290 962	27 344 608,76 €	0,2549%
U-BLOX HOLDING	34 585	5 873 796,95 €	0,4874%
UBM REALITAETEN AG	25 850	1 054 680,00 €	0,3459%
UBS NOM.	256 986	3 396 998,71 €	0,0067%
UCB	537 671	36 206 765,14 €	0,2764%
UMICORE	606 323	29 800 775,45 €	0,2461%
UNI CHARM	92 700	2 389 114,29 €	0,0149%
UNIBAIL RODAMCO SE	75 223	14 183 296,65 €	0,0544%
UNICREDIT SPA	1 446 704	20 682 080,39 €	0,0649%
UNILEVER	60 710	2 877 778,26 €	0,0051%
UNILEVER	505 069	24 134 722,18 €	0,0295%
UNIPER SE	836 291	21 358 872,14 €	0,4321%
UNIPOL	407 747	1 349 234,83 €	0,0568%
UNIPOLSAI S.P.A.	254 108	480 899,39 €	0,0090%
UNIPRES	125 000	2 098 416,61 €	0,2609%
UNI-PRESIDENT CHINA	2 831 000	3 115 353,25 €	0,0655%
UNITED DRUG	350 574	3 274 428,95 €	0,1410%
UNITED OVS BK LCL	146 601	2 464 300,24 €	0,0088%
UNITED PARCEL CL.B	52 800	4 804 028,95 €	0,0076%
UNITED RENTALS	14 856	1 878 328,74 €	0,0180%
UNITED TECHNO.	177 241	18 980 293,98 €	0,0222%
UNITED UTILITIES	93 920	810 535,92 €	0,0138%
UNITEDHEALTH GROUP	87 777	18 444 785,38 €	0,0091%
UOL GROUP	20 800	99 560,92 €	0,0025%
UPM KYMMENE	1 107 019	33 896 921,78 €	0,2074%
VALEO	474 055	22 195 255,10 €	0,1973%
VALLOUREC	995 529	5 055 296,26 €	0,2174%
VALMET OY	198 611	3 281 053,72 €	0,1325%
VENTURE CORP.	120 879	1 354 616,26 €	0,0420%
VEOLIA ENVIRON.	729 030	13 363 119,90 €	0,1294%
VERIZON CIONS	795 881	34 294 696,68 €	0,0193%
VERTEX PHARM.	61 027	8 883 687,14 €	0,0239%
VESTAS WIND SYST.	19 125	1 013 914,80 €	0,0093%
VETO PROMESSES	32 165	1 659 714,00 €	0,2707%
VICAT	35 845	2 014 489,00 €	0,0798%
VICINITY CENTERS	452 274	741 292,03 €	0,0117%
VICTORIA	216 017	2 017 640,55 €	0,1723%
VICTREX PLC	154 589	5 093 824,23 €	0,1795%
VIENNA INSUR.GROUP	214 992	5 022 213,12 €	0,1680%
VIFOR PHARMA RG	8 955	1 225 437,31 €	0,0138%
VILMORIN CLAUSE	5 994	346 453,20 €	0,0288%
VINCI	630 165	51 900 389,40 €	0,1056%
VIRBAC	17 000	1 985 600,00 €	0,2010%
VIRGIN AUS INT HLG	441 960	- €	0,0000%
VISA INC LTD	202 547	22 977 474,33 €	0,0114%
VITROLIFE AB	400 000	5 027 525,40 €	0,3685%
VIVENDI UNIVERSAL	1 476 570	31 007 970,00 €	0,1131%
VIVO ENERGY PLC	1 029 422	1 723 715,84 €	0,0857%
VMWARE A	30 124	3 791 978,31 €	0,0277%
VOCUS COMMUNICATIO	65 657	95 980,05 €	0,0106%
VODAFONE GROUP	1 229 991	2 556 645,51 €	0,0046%
VOESTALPINE	252 814	9 973 512,30 €	0,1434%
VOLKSWAGEN ORD.	19 474	2 755 571,00 €	0,0066%
VOLKSWAGEN PF	195 469	27 799 601,18 €	0,0948%
VOLVO S.B	142 759	1 957 231,64 €	0,0087%
VONOVIA	617 839	25 183 117,64 €	0,1193%
VOYAGEURS DU MONDE	3 961	542 657,00 €	0,1073%
VTECH HOLDINGS	280 153	2 769 431,51 €	0,1114%
VULCAN MATERIALS	162 887	18 005 392,68 €	0,1231%

VZ HOLDING	26 994	7 264 525,81 €	0,3374%
WACKER CHEMIE	22 050	2 472 907,50 €	0,0423%
WALLIX GROUP	90 481	2 379 650,30 €	1,6028%
WALMART	202 001	14 818 539,38 €	0,0069%
WANT WANT CHINA	2 865 465	2 183 521,27 €	0,0230%
WARTSILA	384 945	6 478 624,35 €	0,0651%
WASH TEC	55 533	4 231 614,60 €	0,3973%
WASTE CONNECTIONS	57 350	3 697 749,99 €	0,0218%
WASTE MANAGEMENT	10 200	710 605,97 €	0,0024%
WATERS	4 200	696 396,73 €	0,0054%
WAYFAIR A	6 268	637 563,86 €	0,0105%
WEC ENERGY GROUP	144 200	7 984 694,45 €	0,0457%
WELLS FARGO	543 553	25 810 096,63 €	0,0113%
WENDEL INVEST.	73 984	8 730 112,00 €	0,1599%
WESFARMERS	252 360	7 882 856,35 €	0,0223%
WEST JAPAN RAILWAY	65 000	4 103 346,87 €	0,0338%
WESTPAC BANKING	309 097	5 731 263,19 €	0,0090%
WESTROCK CO	43 019	2 100 932,19 €	0,0169%
WH GROUP	2 191 416	1 528 736,32 €	0,0149%
WHARF HOLDINGS	458 613	1 261 693,31 €	0,0151%
WHARF REAL ESTATE	214 613	1 308 537,28 €	0,0071%
WHEELLOCK	176 278	1 051 708,00 €	0,0086%
WHIRLPOOL	30 000	3 757 355,15 €	0,0465%
WIENERBERGER	260 771	5 575 283,98 €	0,2219%
WILLIAM DEMANT HLD	5 686	195 976,86 €	0,0023%
WILMAR INTL	322 600	620 092,34 €	0,0051%
WING TAI HOLDINGS	111 600	139 504,38 €	0,0146%
WIRECARD	132 818	18 322 243,10 €	0,1075%
WIZZ AIR HOLDINGS	91 693	3 732 626,22 €	0,1260%
WM.MORRIS.SUPERM.	523 467	1 491 645,66 €	0,0221%
WOLTERS KLUWER	222 767	10 750 735,42 €	0,0767%
WOODSIDE PETROLEUM	41 225	925 097,14 €	0,0044%
WOOLWORTHS	332 711	6 425 983,88 €	0,0148%
WORKDAY CL A	22 035	2 285 880,01 €	0,0148%
WORLDLINE	237 046	11 501 471,92 €	0,1776%
WORLDPAY INC	37 027	2 593 523,24 €	0,0123%
WORLEYPARSONS	167 199	1 849 537,10 €	0,0612%
WPP PLC	60 720	819 120,94 €	0,0048%
WYNDHAM HTL	25 160	1 267 751,10 €	0,0252%
WYNDHAM WORLDWIDE	31 133	1 180 470,14 €	0,0313%
WYNN MACAU LTD	388 719	1 071 529,29 €	0,0075%
XEBIO	42 000	573 212,80 €	0,0877%
XERO LIVE LIMITED	37 150	1 058 170,80 €	0,0264%
X-FAB SILICON FOUN	414 129	3 586 357,14 €	0,3167%
XILAM ANIMATION	21 104	1 183 934,40 €	0,4297%
XINYI GLASS HLDGS	710 666	744 031,02 €	0,0178%
XL GROUP	298 614	14 309 839,67 €	0,1154%
XXL	511 853	3 550 052,33 €	0,3680%
YAMABIKO CORP	9 500	97 627,12 €	0,0215%
YAMATO KOGYO	114 700	2 966 753,19 €	0,1695%
YOKOGAWA BRIDGE	70 000	1 423 018,36 €	0,1536%
YONDOSHI HOLDINGS	17 700	370 906,49 €	0,0603%
YUE YUEN IND.	800 439	1 935 569,94 €	0,0490%
ZALANDO	43 901	2 101 540,87 €	0,0175%
ZARDOYA OTIS	163 678	1 338 886,04 €	0,0348%
ZENRIN	15 200	315 227,60 €	0,0265%
ZIGEXN CO LTD	187 900	1 287 307,74 €	0,1684%
ZURICH FINANC.SCES	11 546	2 928 950,36 €	0,0076%

## OBLIGATIONS

**Encours sous gestion dans la poche**

**13 235 767 739 €**

Libellé des valeurs	Quantité de titres	Valeur des titres au 30/06/2018
21ST CEN 3700 150924	1 025 000	879 820,56 €
21ST CENTU 6.15% 37	1 344 000	1 383 761,89 €

2I RETE GAS 1.75 26	800 000	816 844,06 €
A2A SPA 1.75% 2025	3 900 000	3 960 594,25 €
AB 1150 0127	25 780 000	25 641 770,30 €
AB 2000 0135	1 700 000	1 649 244,32 €
ABB FIN 0750 160524	1 200 000	1 208 883,48 €
ABBEY NAT 0.875% 20	4 970 000	5 081 994,35 €
ABBEY NATL 2.625%20	11 670 000	12 563 992,82 €
ABBOTT 2.9% 16-21	2 400 000	2 026 928,18 €
ABBOTT 2950 150325	2 975 000	2 435 802,75 €
ABBOTT 3.4% 16-23	11 650 000	9 860 084,51 €
ABBOTT 3750 1126	9 280 000	7 826 162,48 €
ABBOTT LAB 4.125%20	1 620	1 417 526,02 €
ABBVIE 2.85 05/23	2 100 000	1 736 187,96 €
ABBVIE INC 0.375% 19	15 280 000	15 392 035,89 €
ABBVIE INC 1.37 24	3 000 000	3 049 369,34 €
ABBVIE INC 2.30 0521	3 730 000	3 109 522,48 €
ABBVIE INC 2.50% 20	2 200 000	1 867 560,37 €
ABBVIE INC 2.9% 2022	1 910 000	1 593 847,87 €
ABBVIE INC 3.2% 26	1 425 000	1 144 925,42 €
ABERTI 1000 270227	7 400 000	6 887 230,73 €
ABERTIS IN 3.75 23	3 500 000	3 998 376,61 €
ABN AMR BK 7.125%22	900 000	1 173 096,80 €
ABN AMRO 2.875%25	6 000 000	6 242 685,01 €
ABN AMRO 5750 1299	1 800 000	1 932 414,75 €
ABN AMRO BK 0.625%22	4 505 000	4 564 502,80 €
ABN AMRO BK 0.75% 20	2 720 000	2 763 495,11 €
ABN AMRO BK 2.5% 23	7 000 000	7 826 656,05 €
ABNAMRO NV 0.87 25	2 400 000	2 410 810,84 €
ACCOR 1.25% 0124	3 400 000	3 440 576,98 €
ACCOR 2.375% 23	5 000 000	5 441 176,48 €
ACE HLD 3.35% 24	4 275 000	3 620 235,96 €
ACE INA 2.875% 22	9 805 000	8 273 735,94 €
ACEA 3% 16-2026	3 200 000	2 982 323,87 €
ACEA SPA 2.625% 24	3 200 000	3 481 971,80 €
ACEIM 1.5 080627	3 700 000	3 530 437,87 €
ACEIM EU3M+37 080223	5 100 000	4 998 843,20 €
ACHMEA 4.25% 15-2049	2 080 000	2 124 385,99 €
ACHMEA BK 1.125% 22	6 750 000	6 925 815,30 €
ACHMEA BV 2.5% 20	2 970 000	3 184 125,57 €
ACHMEA BV 6% 43	2 567 000	2 899 938,93 €
ACHMEA HYP 2.75% 21	2 840 000	3 059 611,33 €
ACS SERV 1875 200426	3 300 000	3 241 699,46 €
ACTAVIS FU 3% 0320	1 675 000	1 439 850,11 €
ACTAVIS FU 3.45%2022	7 260 000	6 177 979,87 €
ACTAVIS FUND 3.85%24	2 200 000	1 849 400,03 €
ADECCO INT 1.50% 22	6 517 000	6 850 234,96 €
ADL RE ES 1.875 0423	5 800 000	5 655 706,33 €
ADL RE ES 3% 270426	2 100 000	2 059 337,38 €
ADLER REAL 2.12 24	2 493 000	2 450 214,66 €
ADP INC 2.25% 20	3 300 000	2 805 826,73 €
ADT CORP 6.25 21	1 325 000	1 185 403,37 €
AEGON NV 1% 23	7 000 000	7 186 620,23 €
AEGON NV 4% 2044	1 000 000	1 038 535,74 €
AERC 4625 0722	1 925 000	1 678 869,32 €
AERCA 3650 0727	1 230 000	974 692,43 €
AERCAP 3300 0123	2 582 000	2 160 177,13 €
AERCAP CAP 3.75% 19	1 975 000	1 706 918,98 €
AERCAP CAP 4.25 20	5 230 000	4 526 527,31 €
AERCAP IRE 3.50 0522	1 425 000	1 196 518,17 €
AERCAP IRE 4.5 0521	4 980 000	4 364 553,81 €
AERCAP IRLD 4.125 23	4 050 000	3 451 930,80 €
AERO ROMA 1625 0627	1 850 000	1 830 426,29 €
AEROPORTI 3.25% 21	969 000	1 048 166,64 €
AETNA INC 2.75%22	900 000	742 960,90 €
AHO DELH E3M 0321	2 500 000	2 500 975,00 €
AHODELHAI 1.125 0326	4 600 000	4 565 633,51 €

AHOLD DEL 0875 0924	1 450 000	1 463 170,98 €
AIB 2250 0725	3 410 000	3 378 116,50 €
AIB GRP 1500 0323	5 123 000	5 101 714,99 €
AIG 4200 0428	685 000	579 468,56 €
AIG 6.40 15/12/20	3 437	3 161 227,52 €
AIR LEAS C9 2.5 0321	4 535 000	3 823 636,46 €
AIR LEASE 2.125% 20	1 035 000	878 650,04 €
AIR LEASE 2.75 0123	1 690 000	1 398 687,92 €
AIR LEASE 3.375% 21	1 375 000	1 172 603,96 €
AIR LEASE 3.75% 2022	1 300 000	1 130 181,43 €
AIR LEASE 4.25 24	1 375 000	1 182 143,16 €
AIR LIQ 1.75% 270921	960 000	785 609,52 €
AIR LIQFIN 1.25 25	30	3 098 914,49 €
AIR LIQUIDE 2.25% 23	3 045 000	2 452 587,04 €
AIRL 2625 0722	5 075 000	4 157 913,24 €
AIRLE 3875 0723	2 100 000	1 780 606,07 €
AKELI 1125 0324	2 200 000	2 142 948,79 €
AKELI 1750 0225	3 616 000	3 598 574,86 €
AKELIUS 3875 051078	400 000	393 515,45 €
AKELIUS RSDT 1.5% 22	3 000 000	3 085 095,11 €
ALCOA 6750 300924	1 625 000	1 491 258,14 €
ALD 0875 0722	22 100 000	22 143 470,94 €
ALD SA E3M 0221	1 700 000	1 695 063,20 €
ALEX 4000 0124	7 860 000	6 757 313,35 €
ALEXAN 4600 010422	2 000 000	1 787 479,00 €
ALEXANDRIA 3.9%2023	2 000 000	1 718 076,31 €
ALFA SAB 5.25% 24	750 000	655 418,40 €
ALIBABA 2800 0623	575 000	474 922,27 €
ALIMEN 3550 0727	6 000 000	4 939 327,36 €
ALLEMAGNE 1.5% 23	7 000 000	7 646 569,93 €
ALLIAND 1625 0625	400 000	391 366,78 €
ALLIANDER 0.875 0426	3 000 000	3 019 488,08 €
ALLIANZ 025 06/06/23	3 000 000	2 982 080,50 €
ALLIANZ 2.241% 07/45	1 100 000	1 110 452,65 €
ALLIANZ 3.375% 24	4 500 000	4 806 932,57 €
ALLIANZ 5.75% 2041	180	21 349 111,12 €
ALLIANZ SE 4.75%2049	1 000 000	1 143 777,62 €
ALLIANZ SE 5.625%42	1 800 000	2 171 845,05 €
ALLIANZSE 0 07/47	400 000	417 943,96 €
ALLSTATE 5.75% 2053	2 395 000	2 145 749,47 €
ALLY FCIAL 4.125% 20	3 500 000	3 034 561,16 €
ALLY FINANCIAL 3.75	2 225 000	1 911 945,90 €
ALPHABET 3.375% 24	1 875 000	1 636 969,51 €
ALSTOM S 3% 19	2 000 000	2 119 998,08 €
ALSTRIA 2.125% 23	100 000	106 384,40 €
ALSTRIA OFF 1.5 1127	3 500 000	3 377 367,19 €
ALTERA 4100 1123	2 000 000	1 781 982,21 €
AM IN GP 1.875 0627	1 823 000	1 803 741,90 €
AM AIRLN 3.20% 28	1 350 000	1 010 813,03 €
AM TOWER 3375 151026	1 855 000	1 483 003,03 €
AMADEUS 0.125% 20	1 400 000	1 404 231,86 €
AMADEUS CAP 1.625%21	2 800 000	2 956 624,40 €
AMADEUS ZC 190519	3 600 000	3 601 044,00 €
AMAZON 2.8 0824	8 175 000	6 803 121,42 €
AMAZON 3.15 0827	8 650 000	7 170 579,96 €
AMAZON.COM 2.5% 22	4 000 000	3 331 801,16 €
AME TOW 4.40 150226	415 000	359 652,45 €
AMER AIRLN 3.70 28	1 500 000	1 018 753,30 €
AMER INTL 3.30% 2021	5 360 000	4 634 483,72 €
AMER INTL 4.875%2022	1 800 000	1 617 268,64 €
AMER INTL GP3.9 0426	4 150 000	3 467 320,17 €
AMER TOWER 5% 24	375 000	339 353,78 €
AMERI EXR 2.375 0520	1 750 000	1 480 175,75 €
AMERIC TOW 3.30% 21	7 000 000	6 049 599,59 €
AMERIC TOWER 3.5% 23	374 000	319 632,18 €
AMERICA LIBUS 030519	2 500 000	2 152 343,51 €



AMERICA MO 5.125% 73	1 310 000	1 373 421,41 €
AMERICA MOV 4.125%19	6 983	7 554 223,63 €
america movil 3 0721	2 650	2 942 138,05 €
AMERICAN 0625 221121	6 000 000	6 090 737,96 €
AMERICAN 3000 0623	7 000 000	5 739 094,68 €
AMERICAN 3300 030527	10 865 000	9 005 698,90 €
AMERICAN 3400 270223	2 450 000	2 099 901,07 €
AMERICAN EQUITY	4 632 000	3 869 964,49 €
AMERICAN HONDA F	1 700 000	1 702 994,48 €
AMERICAN LIBUS 0223	640 000	548 828,92 €
AMERICAN TOW 4.7%22	2 000 000	1 790 073,23 €
AMGEN INC	5 425 000	4 518 182,26 €
AMGEN INC 3.12 25	2 880 000	2 370 457,80 €
AMGEN INC 3.875% 21	5 000 000	4 365 794,48 €
AMT 5.9% 2021	2 139	1 975 803,79 €
ANADARKO PE 4.85 321	5 000 000	4 470 600,83 €
ANADARKO PE 5.55 326	1 300 000	1 211 414,50 €
ANALOG DEVICES	575 000	477 657,75 €
ANALOG DEVICES	6 800 000	5 661 729,07 €
AND LOG LP 4.25 1227	3 820 000	3 147 963,26 €
ANDE LOG LP 3.5 1222	1 066 000	895 128,75 €
ANDEA 6875 0223	1 775 000	1 544 289,02 €
ANDEAVOR 380 0100428	5 665 000	4 624 582,33 €
ANDEAVOR 5.125 26	4 325 000	3 876 080,52 €
ANG AMER 1.625 0925	850 000	850 057,31 €
ANGLO 4875 0525	5 810 000	5 024 628,22 €
ANGLO AME 4.75 27	1 800 000	1 531 578,52 €
ANHEU 3500 0124	9 745 000	8 361 250,72 €
ANHEU 4000 0428	14 475 000	12 447 333,24 €
ANHEUS 2.5% 07/22	75 000	62 743,35 €
ANHEUSER 2.65% 21	14 175 000	12 101 700,79 €
ANHEUSER 2625 170123	385 000	321 438,70 €
ANHEUSER 3.30% 23	3 075 000	2 642 973,32 €
ANHEUSER-B 0.875% 22	9 500 000	9 741 978,69 €
ANHEUSER-B 2% 28	2 000 000	2 102 003,22 €
ANHEUSER-B 2.75% 36	6 100 000	6 454 599,02 €
ANHEUSER-BUS 3.65%26	25 310 000	21 529 403,13 €
ANNINGTON F 1.65 724	4 100 000	4 157 514,60 €
ANTER 5375 1121	3 560 000	3 113 873,94 €
ANTH 2500 1120	520 000	438 534,60 €
ANTHEM IN 4.101 0328	615 000	523 522,43 €
ANZ NZ 2.85% 15-2020	2 300 000	1 971 035,29 €
ANZ NZ INTL 0625 122	2 950 000	3 012 155,19 €
ANZ NZ INTL/LDN	6 700 000	6 729 776,14 €
ANZ NZL IN 0.12 23	2 210 000	2 183 738,80 €
AON 2.875% 14-2026	3 796 000	4 120 599,21 €
AON 4%13-2023	2 250 000	1 953 822,11 €
AON PLC 3.50% 24	1 000 000	835 490,75 €
APPLE 1375 0529	1 200 000	1 217 926,86 €
APPLE 2850 0223	12 695 000	10 801 016,11 €
APPLE 3250 0226	11 655 000	9 842 149,74 €
APPLE IN 2850 110524	4 220 000	3 507 949,92 €
APPLE INC	4 050 000	3 293 986,12 €
APPLE INC 0.87 25	8 471 000	8 567 122,17 €
APPLE INC 1.625% 26	14 000 000	14 904 681,81 €
APPLE INC 1.8 2020	2 200 000	1 855 552,22 €
APPLE INC 1550 0821	4 000 000	3 300 467,74 €
APPLE INC 2.25 21	4 600 000	3 900 652,65 €
APPLE INC 2.5 090225	3 000 000	2 438 567,94 €
APPLE INC 2.75 0125	10 803 000	8 988 446,15 €
APPLE INC 2.85 21	790 000	677 545,70 €
APPLE INC 2450 0826	5 310 000	4 209 570,78 €
APPLE INC 3 24	3 500 000	2 964 905,14 €
APPLE L 0.35 110522	7 000 000	6 058 733,47 €
APPLIED M 3,3 010427	1 155 000	966 560,88 €
APRR SA 1.5 0133	4 000 000	3 924 674,85 €

AQUARIUS 4.25%2043	10 452 000	11 918 144,99 €
ARAMARK SERV INC	750 000	626 983,86 €
ARCEL 0950 0123	1 400 000	1 382 500,25 €
ARCELOR 2.875% 2020	5 000 000	5 396 256,50 €
ARCELOR 3.125%2022	3 065 000	3 327 622,06 €
ARDAGH PKG FIN	2 000 000	1 701 374,67 €
ARES CAP 3.875% 20	4 010 000	3 506 438,84 €
ARION BANK 1 23	3 000 000	2 973 890,14 €
ARKEMA	3 000 000	3 014 759,69 €
ARKEMA 1.50%2025	5 800 000	5 974 008,27 €
AROUND 1625 310128	800 000	752 112,76 €
AROUND SA 2% 1126	3 700 000	3 665 045,95 €
AROUNDTOWN 1.50% 24	4 300 000	4 360 849,08 €
ASB FINA 0500 100622	10 760 000	10 753 532,91 €
ASHTead 4.125 150825	2 125 000	1 730 581,40 €
ASR NLD 5 PERP	4 000 000	4 409 965,28 €
ASSICU GEN 7.75%42	2 000 000	2 420 440,68 €
ASSICURA 4.125% 26	1 300 000	1 361 590,91 €
ASSICURAZ 10.125% 42	1 400 000	1 884 748,77 €
ASSOC BANC 2.75%2019	4 200 000	3 580 141,32 €
ASSURANT 4200 0923	3 700 000	3 196 251,12 €
ASTRAZE 075 0524	4 350 000	4 335 966,87 €
AT & T 5.20% 16-2020	4 803 000	4 305 977,64 €
AT AND T 2.45% 2020	385 000	324 353,69 €
AT AND T 3% 06 2022	10 900 000	9 054 781,38 €
AT AND T 4.3 30	13 736 000	11 339 783,39 €
AT T INC TR-050926	16 648 000	16 968 383,28 €
AT& T INC 3.40% 25	2 000 000	1 618 934,24 €
AT& T INC 2.35 29	3 052 000	3 141 313,53 €
AT&T 1,45% 14-2022	3 000 000	3 102 809,80 €
AT&T 1.30% 2023	7 176 000	7 395 689,28 €
AT&T 2.40% 2024	4 200 000	4 526 704,88 €
AT&T 2.45% 2035	10 564 000	9 870 066,28 €
AT&T INC	2 000 000	2 052 310,63 €
AT&T INC 2.65% 21	2 000 000	2 177 441,89 €
AT&T INC 3.20 0322	1 480 000	1 255 929,92 €
AT&T INC 3.375% 34	1 100 000	1 187 302,86 €
AT&T INC 3.55% 32	4 520 000	5 057 595,40 €
AT&T INC 3.6% 23	2 024 000	1 729 852,15 €
AT&T INC 3.80 0324	1 500 000	1 277 891,03 €
AT&T INC 4.25 0327	28 380 000	24 128 718,98 €
ATF 1875 0126	2 800 000	2 798 533,16 €
ATF NETH 2125 130323	4 000 000	4 208 649,39 €
ATF NLD 3750 1299	1 100 000	1 124 185,61 €
ATHENE 4000 0122	5 160 000	4 515 969,23 €
ATLANTI 1625 030225	3 643 000	3 621 990,76 €
ATLANTI 1875 130727	2 750 000	2 668 041,48 €
ATLAS COPCO 2.625%19	2 610 000	2 681 255,50 €
ATR DU SUD 2.875%23	2 800 000	3 145 988,00 €
ATRIUM 3.625% 2022	1 580 000	1 750 553,42 €
ATT 5.80% 0219	4 000	3 560 458,51 €
AUCHAN 0625 070222	4 300 000	4 338 128,96 €
AUST 0625 0223	9 900 000	9 944 823,98 €
AUSTRAL PAC 3.125%23	3 440 000	3 966 527,79 €
AUT DUSUD 1.375 0628	8 900 000	8 905 749,65 €
AUTO SUD 2.95% 24	4 900 000	5 569 320,20 €
AUTONATIO 4.5 1025	3 692 000	3 183 680,01 €
AUTOROUTE 1250 0127	1 700 000	1 725 919,61 €
AUTOSTRDE 1.75 26	3 000 000	2 952 293,15 €
AUTOSTRDE 1.875% 25	4 500 000	4 550 389,37 €
AUTOZONE I 3.75 0627	1 400 000	1 158 243,05 €
AVALONBAY 2.95% 26	2 325 000	1 864 268,13 €
AVALONBAY 4.20% 2018	3 200 000	2 803 381,44 €
AVIATION 2875 0122	8 700 000	7 319 962,35 €
AVIATIONCG 6.75 21	3 250 000	3 054 013,22 €
AVINOR AS 1.25 27	4 330 000	4 413 402,33 €

AVIVA 0.10% 2018	500 000	500 751,71 €
AVIVA PLC 3.375% 45	1 874 000	1 942 582,92 €
AVIVA PLC 0.625% 23	500 000	501 456,05 €
AVIVA PLC 3.875% 44	850 000	901 179,10 €
AVNET 3750 1221	1 375 000	1 175 222,33 €
AXA 3.941%29/11/2049	2 650	2 804 170,59 €
AXA 4350 0428	4 000 000	3 301 480,30 €
AXA 5.125%13-2043	3 000 000	3 571 367,97 €
AXA SA 3.25 49	7 069 000	6 797 476,04 €
AXA VRN 10/99	1 700 000	1 786 290,56 €
B IRELAND 1.25% 2020	3 850 000	3 940 825,19 €
B IRELAND TF/TV 24	4 000 000	4 112 566,58 €
B MONTREAL 1.50 19	7 000 000	5 953 162,61 €
BA AM LIM0 428	3 920 000	3 252 440,84 €
BABCOCK INTL 1.75%22	2 167 000	2 268 812,39 €
BAK HUG 3.337 27	9 250 000	7 379 785,56 €
BALD 1875 0126	1 050 000	1 037 578,13 €
BALL 4.375% 2023	6 000 000	6 702 886,63 €
BALT GAS ELEC 3.5 21	1 500 000	1 299 884,37 €
BALTIMORE 2.4 08/26	2 125 000	1 672 499,04 €
BAN OF AM 2.151 1120	6 250 000	5 240 335,00 €
BAN SAN 2.125 0228	3 400 000	3 159 025,28 €
BANC SANT 3.125 0223	1 200 000	985 596,91 €
BANCO 0875 0323	1 900 000	1 876 436,22 €
BANCO 1125 0125	11 800 000	11 424 471,61 €
BANCO 6.05% 04/20	20	1 100 843,84 €
BANCO B 1375 140525	4 400 000	4 300 778,95 €
BANCO BLB V 0.75 22	1 400 000	1 387 917,50 €
BANCO SANTANDER	6 900 000	7 061 542,52 €
BANCO STDER 3.848 23	7 200 000	6 073 382,38 €
BANCO STDER 3M112 23	7 800 000	6 719 797,39 €
BANK AMER 2.328 21	1 880 000	1 581 707,64 €
BANK AMER 3.666 26	5 575 000	4 649 422,51 €
BANK 7625 1026	1 860 000	1 974 448,16 €
BANK AME E3M 0523	2 050 000	2 056 563,42 €
BANK AMER 2.738 22	1 960 000	1 669 477,30 €
BANK AMER 4.45% 26	2 425 000	2 109 926,20 €
BANK E3M 0424	7 850 000	7 814 384,55 €
BANK OF AM EI3M 0222	11 925 000	12 059 979,08 €
BANK OF AMER 3.3%30	14 185 000	12 140 827,56 €
BANK OF AMER 4.10%23	4 400 000	3 894 288,61 €
BANK OF AMER 5% 21	1 200	5 396 965,15 €
BANK OF AMER CRP	5 015 000	4 362 677,75 €
BANK OF AMER CRP	700 000	584 422,11 €
BANK OF AMER CRP	1 858 000	1 864 611,44 €
BANK OF MTRL 1.75 19	4 000 000	3 398 858,96 €
BANK OF NY MELLO	5 000 000	4 223 873,36 €
BANK OF NY MELLO	2 860 000	2 382 930,99 €
BANKIA SA TF/TV 24	6 700 000	6 873 414,36 €
BARC LIBUS 160529	6 165 000	5 257 828,95 €
BARC PLC L3M 0529	1 450 000	1 236 255,21 €
BARCL PLC 0.625 1123	7 050 000	6 852 489,88 €
BARCLAYS 1.875 0321	5 627 000	5 856 850,16 €
BARCLAYS 1.875 1223	8 765 000	9 043 106,11 €
BARCLAYS 2.625% 2025	200 000	207 130,37 €
BARCLAYS 2.75% 2019	1 420 000	1 211 857,45 €
BARCLAYS 2000 0228	12 500 000	12 044 302,50 €
BARCLAYS 2650 0121	2 500 000	2 119 997,24 €
BARCLAYS 3.20% 2021	1 900 000	1 612 825,24 €
BARCLAYS 3.25 0121	1 025 000	879 432,09 €
BARCLAYS 5.2 0526	3 915 000	3 312 724,98 €
BARCLAYS BK 5.14%20	9 315	8 242 799,21 €
BARCLAYS BK 6.625%22	2 000	2 393 001,50 €
BARCLS PLC 1375 0126	6 109 000	5 838 929,64 €
BARRICK NO 4.40% 21	235 000	210 907,91 €
BASF SE 0.875 1127	1 440 000	1 405 487,95 €

BASF SE 0.875 25	4 950 000	4 973 212,27 €
BASF SE 1.625 1137	7 350 000	7 036 568,99 €
BAWAG 8.125 10/23	2 000 000	2 786 500,55 €
BAYER 4250 1225	3 000 000	2 580 209,27 €
BAYER 4375 1228	4 450 000	3 805 233,94 €
BAYER AG 2.375% 75	3 612 000	3 656 206,78 €
BAYER AG 3% 75	2 000 000	2 053 645,17 €
BAYER CAP 0.625 22	2 200 000	2 210 614,70 €
BAYER CAP 1.5 26	5 800 000	5 827 275,49 €
BAYER CAP 2.125 29	5 500 000	5 574 153,94 €
BB&T CO 2050 150521	6 725 000	5 572 600,69 €
BB&T CORP 2.15 0221	1 845 000	1 553 475,27 €
BB&T CORPOR 2.45% 20	16 590 000	14 233 302,55 €
BBT CORP 5.25 19	5 101 000	4 528 277,98 €
BBVA 0,625 170122	2 100 000	2 111 512,81 €
BBVA Eurib3 03/23	1 000 000	981 770,50 €
BBVA SUB 3.5% 24	8 300 000	8 534 216,90 €
BC SAN ER+0.75 0323	3 700 000	3 658 150,43 €
BCO SAN 6.25% 2019	7 000 000	7 138 920,83 €
BCPE EUR3M 0323	3 000 000	2 953 527,50 €
BECT 1401 0523	5 875 000	5 934 780,14 €
BECTN 2133 0619	4 105 000	3 490 031,42 €
BECTN 2894 0622	7 350 000	6 093 789,28 €
BECTON 0368 0619	11 895 000	11 932 729,98 €
BECTON DCK 3.70 27	5 025 000	4 085 870,95 €
BECTON DICK.2.675%19	240 000	204 207,61 €
BECTON DICKI 1 1222	3 438 000	3 457 630,13 €
BELDEN 3375 0727	900 000	864 531,00 €
BELFIUS 0750 0922	5 300 000	5 311 439,50 €
BELFIUS 1000 1024	8 800 000	8 642 671,97 €
BELFIUS BK 3.125% 26	2 000 000	2 084 347,74 €
BELFIUS BK 3.625% 25	1 400 000	1 206 345,57 €
BEN STABI 2.375 0228	4 600 000	4 595 970,91 €
BENI STAB 1625 1024	3 650 000	3 704 169,00 €
BERKSH HAT 1.125%27	9 150 000	9 114 947,16 €
BERKSHIR HAT 0.75%23	4 943 000	5 013 050,35 €
BERKSHIRE 1.7% 19	3 400 000	2 909 984,15 €
BERKSHIRE 2.20%16-21	6 400 000	5 422 801,59 €
BERKSHIRE 2.75%16-21	5 020 000	4 232 613,93 €
BERKSHIREH 1.30% 24	4 000 000	4 147 476,03 €
BERTEL 1.125% 26	7 500 000	7 555 520,02 €
BEVCO LUX SARL	7 142 000	7 172 647,82 €
BFCM 0.25 06/19	4 200 000	4 217 074,42 €
BFCM 0.75 170725	14 200 000	14 002 635,72 €
BFCM 1.25% 25	7 500 000	7 715 236,63 €
BFCM 1.625% 26	300 000	315 380,34 €
BFCM 1.685% 04-2015	3 100 000	2 392 316,50 €
BFCM 1250 0527	4 400 000	4 421 314,35 €
BFCM 1625 1127	3 000 000	2 808 879,68 €
BFCM 2.50 05/28	4 500 000	4 459 778,25 €
BFCM 2.625% 21	3 000 000	3 231 732,29 €
BFCM 3% 13-2023	1 000 000	1 145 466,12 €
BFCM 3% 14-2024	11 700 000	12 495 117,34 €
BFCM 4.125% 2020	3 000 000	3 374 742,80 €
BFIFTH CIN 2.25 0621	3 900 000	3 253 738,38 €
BG ENERGY 1.25%11/22	6 325 000	6 606 900,40 €
BHARTI AIR 4% 18	3 859 000	3 999 605,57 €
BHP BILLI TF/TV 79	2 200 000	2 663 937,40 €
BIMBO 3.875% 24	3 525 000	2 948 663,28 €
BIOGEN INC 3.625% 22	7 900 000	6 828 589,35 €
BIOGEN INC 5.2% 2045	1 200 000	1 099 348,21 €
BK AMER 3.093% 1025	4 025 000	3 309 578,13 €
BK AMERICA 3.875%25	5 550 000	4 798 042,20 €
BK F C M 2.2625 0327	600 000	611 906,86 €
BK NOVA 2800 210721	8 925 000	7 622 961,33 €
BK NY MELLON 2.60%20	7 960 000	6 813 142,47 €

BK OF A 3248 211027	2 465 000	1 975 580,69 €
BK OF AMER 2.375% 24	10 121 000	10 891 614,55 €
BK OF NY 4625 0926	2 375 000	1 957 857,28 €
BK OF NY ME 4.95% 20	3 120 000	2 723 670,08 €
BK OFAM CRP L3M 0329	2 565 000	2 183 117,57 €
BK POSTALE 2.75% 26	6 700 000	6 991 319,46 €
BKAMERICA 2.50% 2020	7 584 000	8 145 302,94 €
BKAMERICA 3.50 26	5 400 000	4 487 078,06 €
BKAMERICA 4% 01/25	5 200 000	4 466 637,17 €
BKAMERICA 5.49 19	3 400 000	3 009 722,92 €
BKAMERICA TF/TV 25	6 866 000	7 008 168,08 €
BKMO 3.803% 1232	3 325 000	2 633 035,19 €
BLACK 1400 0722	3 020 000	3 024 530,00 €
BLACK 4.25% 11/23	6 000 000	5 238 949,08 €
BLACK HILLS 2.50%19	2 208 000	1 909 416,38 €
BLACK HILLS 3.15% 27	1 075 000	866 270,18 €
BMBG BOND 3%2021	2 800 000	2 836 848,00 €
BMW FI 0.875 030425	2 700 000	2 684 162,09 €
BMW FI 0500 22/11/22	3 500 000	3 505 988,30 €
BMW FI 1125 220526	3 100 000	3 081 752,23 €
BMW FI NV 0.375 0723	1 500 000	1 486 102,91 €
BMW FIN 0.125% 20	4 550 000	4 566 324,25 €
BMW US CA 1.125% 21	4 500 000	4 677 366,65 €
BNP 1125 0626	8 538 000	8 188 455,83 €
BNP 0,5 010622	5 000 000	5 028 841,78 €
BNP 0.75% 16-2022	11 250 000	11 453 148,21 €
BNP 1 27/06/24	2 880 000	2 825 756,88 €
BNP 2.375% 20/05/24	5 410 000	5 941 983,23 €
BNP E3M 0624	2 050 000	2 035 361,18 €
BNP PAR 2875 1026	2 460 000	2 630 158,59 €
BNP PARI 3.375 0125	2 598 000	2 136 126,54 €
BNP PARI 4250 151024	2 500 000	2 126 993,13 €
BNP PARIB 1.12 23	8 886 000	9 189 030,40 €
BNP PARIB 1.5 11/25	3 540 000	3 558 241,84 €
BNP PARIB 2.625% 27	5 300 000	5 628 704,23 €
BNP PARIB 2.95 22	2 042 000	1 693 165,74 €
BNP PARIBAS	16 100 000	15 863 122,13 €
BNP PARIBAS 1.375%18	2 490 000	2 526 300,11 €
BNP PARIBAS 1.50% 28	970 000	1 001 596,53 €
BNP PARIBAS 2% 2019	4 200 000	4 289 367,37 €
BNP PARIBAS 2.25%27	950 000	956 318,24 €
BNP PARIBAS 2.875%26	4 200 000	4 408 154,72 €
BNP PARIBAS 3.8% 24	5 650 000	4 813 405,66 €
BNP PARIBAS TV08-18	72	3 601 368,00 €
BNP PRBAS 1.125% 23	3 250 000	3 275 516,17 €
BNPP 4,875%PERP	5 512	5 769 589,35 €
BNPP 5% 15/01/2021	5 500	5 000 396,84 €
BNPP CA 4.032% 99	2 100 000	2 221 828,49 €
BNPP CRDIF 1 24	16 600 000	15 687 777,01 €
BNZ 2650 1122	4 826 000	3 965 940,98 €
BNZ INTL FUND/LN	2 726 000	2 322 405,84 €
BNZ INTL FUND/LN	3 763 000	3 722 113,99 €
BOA 3.95% 2025	3 000 000	2 533 690,21 €
BOA 3499 17/05/22	17 345 000	14 907 904,47 €
BOA 3824 0128	9 980 000	8 453 567,50 €
BOA 4.2% 24	6 005 000	5 233 135,53 €
BOA 4.25% 26	8 905 000	7 590 258,37 €
BOA 5.625% 2020	272	1 218 464,13 €
BOA CORP 1.375% 21	6 225 000	6 508 093,61 €
BOA TV 18-201223	3 581 000	2 973 420,89 €
BOST PR LP 3.20 0125	1 435 000	1 189 416,91 €
BOSTON 4.125% 2023	1 162 000	1 021 612,20 €
BOSTON PP 3.85% 23	4 000 000	3 496 742,94 €
BOSTON PRO 3.65% 26	2 900 000	2 432 967,51 €
BOSTON PRO 3.8% 24	2 225 000	1 922 726,34 €
BOSTON S 3375 150522	1 335 000	1 135 095,88 €

BP 3.561ù 2021	11 600	10 089 459,86 €
BP CAP 1953 0325	11 786 000	12 558 657,58 €
BP CAPIT 1.526% 22	7 000 000	7 404 108,61 €
BP CAPIT 3.119% 26	2 125 000	1 749 890,67 €
BP CAPITAL 0.9 24	2 000 000	2 005 580,00 €
BP CAPITAL 1.573%27	4 000 000	4 099 628,55 €
BP CAPITAL 1.594 28	2 200 000	2 213 112,00 €
BP CAPITAL 2.213% 26	3 576 000	3 897 202,29 €
BP CAPITAL PLC	3 900 000	3 202 858,60 €
BP CAPMKTS 1.117 24	7 764 000	7 949 511,74 €
BP CAPMKTS 3.06 22	3 375 000	2 894 674,64 €
BPCE SA 3500 1027	4 025 000	3 171 790,17 €
BPCE 0,375% 05/10/23	6 000 000	5 948 717,68 €
BPCE 0.625% 20/04/20	2 200 000	2 229 806,75 €
BPCE 0.875 0124	9 600 000	9 428 058,31 €
BPCE 1,125 180123	8 200 000	8 263 015,67 €
BPCE 1.125%15-2022	4 000 000	4 152 980,82 €
BPCE 1.375 0326	6 400 000	6 258 554,02 €
BPCE 2.125% 2021	1 700 000	1 805 387,54 €
BPCE 2.65% 16-2021	7 500 000	6 359 866,82 €
BPCE 2.75% 11/2027	5 400 000	5 748 934,66 €
BPCE 2.875% 24	500 000	566 449,29 €
BPCE 2.875% 26	1 000 000	1 052 015,93 €
BPCE 3% 14-2024	400 000	466 930,41 €
BPCE 4.25% 02/2023	1 700 000	2 023 100,36 €
BPCE 4.625% 23	9 400 000	11 242 890,82 €
BPCE 5.15% 14-2024	4 300 000	3 813 540,75 €
BPCE 5.7% 2023	3 210 000	2 902 710,08 €
BPCE SA 08/07/2026	4 000 000	4 275 944,76 €
BPCE SA 1.625 0128	3 200 000	3 148 336,14 €
BPCM 1077 0625	19 030 000	19 035 616,67 €
BPCM 1637 0629	4 331 000	4 347 900,62 €
BRANDY 3950 1127	3 810 000	3 117 333,05 €
BRANDY OPE 3.95 23	3 000 000	2 595 130,83 €
BRCLYS PLC 3.684% 23	8 179 000	6 932 368,29 €
BREN FIN 1.125 0925	200 000	198 478,30 €
BRIGHTHOUSE FIN	1 400 000	985 517,16 €
BRIGHTHOUSE FIN2	18 085 000	13 772 211,25 €
BRISA CNCSS 2.375 27	2 300 000	2 379 726,51 €
BRISA CONCES 2% 23	4 100 000	4 337 856,73 €
BRIT SKY 1.875% 2023	2 425 000	2 575 735,19 €
BRIT SKY 2.625% 19	4 701 000	4 030 817,44 €
BRITISH SKY 1.50% 21	7 388 000	7 737 958,51 €
BRITISH TEL 0.625%21	5 370 000	5 436 775,29 €
BRITISH TELECO 1 211	1 519 000	1 507 089,50 €
BRIX OPER 4.125 0626	2 400 000	1 992 834,57 €
BRIXMOR 3850 010225	2 500 000	2 096 367,51 €
BRIXMOR OP 3.25 0923	5 307 000	4 386 416,98 €
BRK 3.45% 2021	2 600	2 262 671,41 €
BROADCOM 2.375PCT 1	6 900 000	5 892 928,78 €
BROADCOM 2,2PCT 17-1	3 750 000	3 157 330,88 €
BROADCOM 3.875PCT 17	2 890 000	2 378 320,70 €
BROADCOM. 2.65PCT 17	6 140 000	5 055 906,21 €
BROOK 4000 0424	6 060 000	5 178 325,78 €
BROOKFIELD 4.25 626	8 150 000	6 877 884,67 €
BT 1.125% 10/06/19	3 280 000	3 318 882,77 €
BUCKEY PA 4.125 1227	1 650 000	1 286 035,72 €
BUCKEYE PART 3.95%26	2 075 000	1 621 276,23 €
BUND 0 07/10/22	10 000 000	10 167 951,00 €
BUND 0.5 15/08/27	8 000 000	8 224 243,32 €
BUNDERSREPUB DEUTSCH	9 460 000	14 070 103,61 €
BUNGE FIN 3.25% 2026	2 205 000	1 741 447,32 €
BURL NTHN 3.65 0925	2 620 000	2 267 643,48 €
BURLINGTON 3% 0425	1 600 000	1 324 957,96 €
BURLINGTON 305% 0922	3 675 000	3 142 379,52 €
BUZZI 2125 0423	1 000 000	1 032 052,47 €

C SUISSE 3574 090123	1 675 000	1 431 062,06 €
CA ASSUR 4.25% 2025	10 000 000	10 500 160,59 €
CA ASSUR 4.5% 49	5 500 000	5 905 070,60 €
CA LOND 1,25 140426	9 100 000	9 256 762,29 €
CA LONDON 2.375% 24	9 300 000	10 185 668,89 €
CA LONDON 3.125% 23	2 400 000	2 776 557,05 €
CAFBQ EU3M 0622	3 800 000	3 792 436,10 €
CAIXABANK	4 200 000	4 137 648,73 €
CAIXABANK 1.125 0524	6 500 000	6 417 243,50 €
CAIXABANK 1125 0123	800 000	791 075,98 €
CAIXABANK 2.75 0728	2 400 000	2 495 978,96 €
CAIXABANK 2250 0430	12 100 000	11 427 924,56 €
CAIXABANK VRN 23	2 200 000	2 305 014,44 €
CAIXABK 3500 150227	3 000 000	3 188 978,63 €
CALDN EU3M 0323	6 900 000	6 826 992,83 €
CANADIAN NATL RE	1 800 000	1 501 470,60 €
CANADIAN NTL 3.80%24	830 000	709 122,58 €
CAP GEMINI 2.5% 23	3 000 000	3 248 611,16 €
CAPGEMINI SE 1 24	2 000 000	1 995 130,78 €
CAPGEMINI SE 1.75 28	1 600 000	1 618 988,22 €
CAPITAL 2350 310120	1 375 000	1 171 941,51 €
CAPITAL FI 2.50 0520	1 500 000	1 269 776,45 €
CAPITAL ON 3.75 0327	5 975 000	4 914 463,73 €
CAPITAL ONE 2.95% 21	4 500 000	3 836 807,84 €
CAPITAL ONE 3.2% 25	1 875 000	1 530 232,47 €
CAPITAL ONE 5.50% 24	4 056 000	3 440 427,28 €
CAPITNE FI 3.45 0421	5 000 000	4 299 291,25 €
CARDETY SA 2.12 28	4 900 000	4 891 375,33 €
CARDINAL H 3.079 624	5 540 000	4 478 545,87 €
CARGILL INC 2.5% 23	961 000	1 060 807,88 €
CARLI COS 3.5 1224	4 775 000	3 940 693,39 €
CARLSB BR 2.625%2019	3 705 000	3 804 098,75 €
CARLSBERG 2.5% 24	6 100 000	6 660 323,14 €
CARLSBERG BRW 0.5 23	1 400 000	1 389 191,98 €
CARMILA 2.375% 23	3 200 000	3 468 429,84 €
CARMILA 2.375% 24	1 000 000	1 074 884,96 €
CARREFOUR 0875 0623	5 700 000	5 714 287,19 €
CARREFOUR 1.25% 2025	1 381 000	1 381 812,02 €
CASINO 3.248%14-2024	6 100 000	6 167 719,03 €
CASINO 4.407%2019	400 000	429 901,94 €
CASINO 5.976% 21	2 300 000	2 478 966,65 €
CASINO GUI 1.865 622	900 000	843 607,73 €
CATERPILLAR F 2.5 20	2 745 000	2 321 082,52 €
CDT AGRI 4125 100127	3 433 000	2 902 540,90 €
CELA US HL 1.25 0225	3 500 000	3 463 610,55 €
CELG 3.875% 15/08/25	1 000 000	844 789,66 €
CELGENE 3.55% 2022	3 400 000	2 926 374,31 €
CELGENE 3900 0228	8 495 000	7 002 260,19 €
CEMEX 2.75 12/24	3 100 000	3 006 407,56 €
CEMEX SAB 6125 0525	2 140 000	1 875 161,01 €
CENOVUS NRGY 4.25 27	1 775 000	1 473 815,29 €
CENTENE CORP	3 500 000	3 120 884,54 €
CFCM NORD 2.125%26	2 000 000	1 991 192,88 €
CH ROBINSON 4.2 28	1 289 000	1 099 303,39 €
CHAR 3250 0521	1 770 000	1 524 031,91 €
CHARL SCH 3.2 012028	7 000 000	5 826 155,44 €
CHART 4200 0328	5 400 000	4 389 514,80 €
CHARTER COMM 4.5 24	1 360 000	1 166 113,66 €
CHARTER COMM OPT	4 830 000	4 270 530,00 €
CHEVRON CORP 2.35%22	3 000 000	2 481 071,47 €
CHEVRON PHIL 2.45 20	6 750 000	5 737 106,55 €
CHORUS LT TF 23	3 399 000	3 433 963,32 €
CHRTER C OT 4.908 25	20 078 000	17 745 153,83 €
CHUBB 2500 0338	1 110 000	1 126 862,67 €
CHUBB INA HL 1.55 28	10 419 000	10 383 628,11 €
CI D ST GO 1.375 627	15 800 000	15 461 725,99 €

CIE DE ST GOB 1% 325	3 100 000	3 068 793,87 €
CIE FINAN RI 1% 0626	6 394 000	6 431 230,53 €
CIGNA 3050 1027	3 525 000	2 728 424,37 €
CIMAREX EN 3.9% 0527	5 845 000	4 819 928,53 €
CINTAS CORP 3.7 0427	2 470 000	2 093 805,08 €
CINTAS CORP NO.2	1 145 000	966 820,24 €
CISCO SYSTEM 1.85%21	5 000 000	4 142 276,80 €
CISCO SYSTEMS	1 725 000	1 471 794,14 €
CIT GROUP 3875 0219	1 600 000	695 160,71 €
CIT GROUP IC 5.25 25	1 162 000	1 020 689,93 €
CITI FINAN 4.35 25	1 861 000	1 601 501,91 €
CITIGR IN 1.625 0328	5 637 000	5 624 152,92 €
CITIGR L3MUS 0923	5 065 000	4 438 727,46 €
CITIGRO 3887 100128	12 150 000	10 266 015,77 €
CITIGROU 3700 120126	2 000 000	1 684 287,61 €
CITIGROU 4075 230429	10 000 000	8 443 695,01 €
CITIGROU I 2.65 1020	9 500 000	8 044 930,39 €
CITIGROUP 0 07/28	335 000	279 389,28 €
CITIGROUP 0.75% 2023	8 611 000	8 595 297,72 €
CITIGROUP 1.375% 21	8 190 000	8 543 209,61 €
CITIGROUP 1.75% 2025	1 767 000	1 843 166,98 €
CITIGROUP 2.125% 26	10 640 000	11 409 441,99 €
CITIGROUP 2.50% 2019	1 800 000	1 550 854,35 €
CITIGROUP 2350 0821	6 000 000	5 010 990,24 €
CITIGROUP 3.375%2023	7 500 000	6 393 500,27 €
CITIGROUP 3.4% 26	5 225 000	4 260 891,42 €
CITIGROUP 5.50% 25	4 095 000	3 775 219,82 €
CITIGROUP 8.5%09-19	4 000	3 623 247,16 €
CITIGROUP I 4.6 0326	5 000 000	4 343 911,04 €
CITIGROUP TV250422	7 140 000	6 208 154,95 €
CITIGRP 4.4% 25	4 060 000	3 462 696,51 €
CITIGRP 4.45% 27	6 570 000	5 598 635,14 €
CITIZENS 2250 020320	7 300 000	6 192 088,77 €
CITIZENS 2250 1020	3 775 000	3 158 666,70 €
CITIZENS 2550 130521	3 400 000	2 847 903,45 €
CITIZENS BANK 2.5%19	2 000 000	1 721 980,98 €
CITIZENS BK 230 1218	5 240 000	4 486 848,65 €
CITIZENS F G 6 23	2 700 000	2 345 511,54 €
CITY NATIONAL	2 300	2 087 049,81 €
CITYCON OY 3.75% 20	3 924 000	4 190 564,61 €
CLOVERIE 1.75% 2024	10 569 000	11 322 541,26 €
CM ARKEA 1.25 0524	5 200 000	5 095 094,35 €
CNA 3.95% 05/2024	3 500 000	3 005 124,69 €
CNH 4875 0421	3 000 000	2 658 203,07 €
CNH CAPITA 4.37 22	4 873 000	4 237 614,91 €
CNH I FIN 1.375 0522	3 000 000	3 027 230,16 €
CNH IN FIN 2.875% 23	4 480 000	4 753 939,25 €
CNH IND CP 4.375% 20	2 000 000	1 744 348,57 €
CNP 4.25% 2045	100 000	106 488,54 €
CNP ASSU 4% 99	3 100 000	3 237 823,87 €
CNP ASSUR 1.875 1022	4 400 000	4 534 716,06 €
COCA-COLA 0 090321	1 400 000	1 400 779,94 €
COCACOLA 0.75% 2023	6 430 000	6 554 793,20 €
COCA-COLA 1.125% 27	4 916 000	4 939 087,22 €
COCA-COLA 3.8% 11/25	3 495 000	2 943 490,50 €
COFIROUTE 0375 0225	4 800 000	4 648 360,80 €
COLFAX CP 3250 0525	500 000	503 901,67 €
COLUMBIA PIPELIN	5 690 000	4 885 831,52 €
COM BK AU 1.936 1029	3 841 000	3 814 660,03 €
COM BK AUST 0.5 0722	1 500 000	1 514 935,03 €
COM BK AUST 1.625%19	4 010 000	4 080 830,88 €
COM BK AUST 45 1225	4 450 000	3 782 242,73 €
COMCAST 3.15 150228	1 900 000	1 518 852,73 €
COMCAST 3.375% 2025	2 480 000	2 070 148,43 €
COMCAST 5.15% 2020	4 000 000	3 591 084,84 €
COMCAST 9.455% 02-22	651	691 439,26 €



COMCAST CORP	6 210 000	5 144 461,05 €
COMMER AG 8.125 0923	1 900 000	1 884 234,70 €
COMMERZ 1.125 0925	2 000 000	1 967 176,18 €
COMMERZB 4% 0326	12 527 000	13 382 573,83 €
COMMERZBK 0.50% 2023	5 989 000	5 849 986,92 €
COMMONW BK 2.55%2021	7 470 000	6 316 054,39 €
COMMS 5000 0621	1 500 000	1 289 649,27 €
COMPASS 3500 110621	4 150 000	3 551 426,40 €
COMPASS GRP 1.875%23	3 650 000	3 901 843,32 €
COMPASS GRP 3.125%19	5 607 000	5 787 076,10 €
COMZBK AG 7.75 21	32	3 816 494,20 €
CON /MIDLA3.75 1027	4 075 000	3 381 924,83 €
CONCHO 4300 150828	2 250 000	1 924 548,20 €
CONCHO R 4375 150125	1 300 000	1 137 455,93 €
CONS EDI 2000 150320	970 000	819 251,42 €
CONSTE 4250 0523	2 165 000	1 901 427,31 €
CONSTELLATION BR	455 000	378 157,98 €
CONT 4375 0128	2 250 000	1 962 191,93 €
CONT AIRLN 4% 26 A	7 230 000	4 829 509,48 €
CONT AIRLN 7.25% 21	605	334 265,32 €
CONTIN 0000 050220	2 703 000	2 706 259,55 €
CONTIN RESO 3.8% 24	1 330 000	1 110 872,97 €
CONTINE 4500 150423	5 015 000	4 391 620,31 €
CONTL RUB 0.50% 19	3 256 000	3 274 610,05 €
COOP 3125 0421	1 665 000	1 425 971,81 €
COVENTRY 5.45%11-21	4 225	3 810 822,99 €
COVENTRY BG 2.5%20	300 000	321 551,08 €
COVIDIEN I 4.20 20	328	287 613,48 €
CPI 4375 0823	1 500 000	1 416 378,70 €
CPI PROP 2125 1024	6 480 000	6 453 454,79 €
CPL ONE BANK 2.4% 19	7 275 000	6 223 124,71 €
CR AGRICOLE 3.875%19	5 100 000	5 304 474,37 €
CR LOG 1350 1129	3 000 000	2 900 437,28 €
CR MU ARK 1.875 1029	2 800 000	2 609 878,70 €
CR SUISSE 1.375% 19	4 620 000	4 751 997,49 €
CR. AGRI.ASSU TV48	3 800 000	4 217 735,21 €
CRD MU ARK 3.25 0626	1 300 000	1 313 481,02 €
CRDAG ASR 2625 0148	3 600 000	3 283 003,29 €
CRDT SUISSE 4.375%20	2 500 000	2 228 440,14 €
CRE SUISSE 1,5% 2026	5 400 000	5 582 460,90 €
CREAGR 0.875% 2022	8 300 000	8 507 601,09 €
CRED 3750 0423	4 000 000	3 379 444,14 €
CRED AGRI 3.875% 24	2 427 000	2 088 826,50 €
CRED SUIS GP 1.25%22	3 261 000	3 323 826,18 €
CRED SUIS NY 3.62%24	6 800 000	5 791 250,34 €
CREDI AGRI 2.625% 27	6 267 000	6 406 015,99 €
CREDIT AGR 1.375 25	6 200 000	6 177 380,41 €
CREDIT AGR 1125 0325	5 400 000	5 414 565,31 €
CREDIT AGR 1625 0329	3 900 000	3 907 453,43 €
CREDIT L3M 0423	5 006 000	4 306 222,15 €
CREDIT SUIS 1% 2023	10 637 000	10 842 446,52 €
CRH FINA 1375 181028	350 000	338 907,44 €
CRH FINANCE 3.125%23	5 155 000	5 789 521,71 €
CRITERI S 1.625 22	15	1 525 302,30 €
CRITERIA CXA 1.5 23	2 800 000	2 789 797,02 €
CROWN 3650 0927	7 620 000	6 145 467,14 €
CROWN 3800 0228	3 890 000	3 177 794,93 €
CROWN CASTL 3.222%22	2 000 000	1 690 156,31 €
CROWN CASTL 3.4 0221	7 500 000	6 489 379,47 €
CROWN CASTL 4.241 28	3 545 000	3 036 272,54 €
CROWN CASTLE 5.25%23	2 021 000	1 854 566,74 €
CROWN EU 3.375 0525	2 000 000	2 030 760,00 €
CROWN EUROPEAN 4%22	250 000	276 306,67 €
CRWCASTINT 4 0327	4 395 000	3 669 905,20 €
CS AG 5.75% 09/25	2 888 000	3 279 092,56 €
CS GR FDG 3.45% 21	10 500 000	9 015 111,77 €

CS GR FDG 3.80 22	5 825 000	5 016 170,40 €
CS LONDON 1.375%22	20 227 000	21 048 725,90 €
CSAG 1250 0725	6 600 000	6 588 290,60 €
CSC HOLDIN 5.5 0427	2 325 000	1 925 170,23 €
CSNY 3% 29/10/21	4 000 000	3 396 011,59 €
CSTEL BRD 4.75 25	4 000 000	3 557 953,74 €
CSX CORP 2.60 26	500 000	387 438,56 €
CSX CORP 3400 010824	1 080 000	921 050,75 €
CTEFR 0875 0924	6 900 000	6 937 500,74 €
CTEFR 2125 0732	4 300 000	4 477 078,63 €
CUBESMAR L 3.125 926	975 000	778 781,01 €
CVS 3700 0323	19 025 000	16 358 626,68 €
CVS 4300 0328	18 120 000	15 484 241,38 €
CVS 5050 0348	3 210 000	2 829 907,37 €
CVS 4% 05/12/23	1 260 000	1 086 015,33 €
CVS CARRK 2.75% 22	1 390 000	1 144 149,53 €
CVS HEALTH 2.125 621	355 000	292 990,59 €
CVS HEALTH 2.80% 20	3 600 000	3 092 962,19 €
CVS HEALTH 3.50% 22	1 365 000	1 175 904,12 €
CVS HEALTH 3.875% 25	2 115 000	1 799 684,01 €
CVS HEALTH 4.1 25	18 843 000	16 247 592,15 €
D S SMITH 1.37 24	3 100 000	3 099 744,44 €
D.R. 2250 1220	4 960 000	4 169 223,65 €
DAIMLER 0250 110522	9 160 000	9 103 217,29 €
DAIMLER 1000 1125	4 850 000	4 750 034,01 €
DAIMLER 2.3 120221	5 150 000	4 323 293,14 €
DAIMLER AG 0.85 25	2 500 000	2 462 217,65 €
DAIMLER AG 0.875%21	11 300 000	11 564 310,25 €
DAIMLER BZ 0.50 19	19 334 000	19 544 363,45 €
DAIMLER BZ 2.25% 22	3 000 000	3 236 164,54 €
DAIMLER E3M 0522	3 400 000	3 382 626,00 €
DAIMLER FI 2.25 19	3 000 000	2 574 165,99 €
DAN BANK 2.75% 05/26	2 000 000	2 108 898,02 €
DANFOSS 1.375% 2022	3 577 000	3 707 676,25 €
DANO PERP 1750 0623	5 100 000	4 899 210,72 €
DANONE 1.125 25	4 500 000	4 612 118,52 €
DANONE 1.691%16-2019	3 575 000	3 015 759,98 €
DANSKE 0875 220523	5 750 000	5 724 434,06 €
DANSKE BANK 0.75%23	2 330 000	2 355 297,24 €
DANSKE BK 3.875% 23	9 105 000	9 452 690,01 €
DARDEN 3850 0527	14 535 000	12 036 961,36 €
DBOER 1125 0328	9 695 000	9 766 375,27 €
DBR 2.50% 2044	2 280 000	3 152 896,42 €
DE VOLKS0,125 280920	8 503 000	8 518 112,85 €
DE VOLKSBK 0075 0623	8 800 000	8 809 055,06 €
DELAIR LI 3.625 0325	3 150 000	2 684 022,31 €
DELL 6020 0626	2 000 000	1 807 562,85 €
DELT AIR L 2.875 320	1 055 000	902 982,34 €
DELTA 2600 1220	645 000	541 265,49 €
DELTA 3800 190423	3 135 000	2 675 043,66 €
DELTA LL 4.375% 49	4 324 000	4 476 232,30 €
DELTA LLOYD 9% 42	1 483 000	1 983 989,00 €
DEMETER INV 4.375%25	3 385 000	3 560 778,89 €
DEMETER INVT.3.5% 46	1 249 000	1 345 402,40 €
DEU TELE Eurib3 22	1 750 000	1 743 237,61 €
DEU.BK .4.875%1232	1 775 000	1 303 034,92 €
DEU.TELEK.8.25%30	100	114 138,58 €
DEUT 1375 1225	10 160 000	10 301 609,88 €
DEUT 2000 1229	4 759 000	4 860 287,82 €
DEUT 2700 0720	4 200 000	3 544 612,23 €
DEUT 3150 0121	8 475 000	7 120 201,33 €
DEUT BAHN 0.875%31	4 782 000	4 600 179,84 €
DEUT E3M 1220	5 400 000	5 276 926,20 €
DEUT T 0625 1222	1 500 000	1 508 631,97 €
DEUT TEL FI 0.625%23	6 000 000	6 024 442,31 €
DEUT TEL FIN 1.5% 28	1 600 000	1 600 317,80 €

DEUTANNIG TF/TV 74	7 000 000	7 234 200,82 €
DEUTK 5851 0323	1 100 000	1 376 454,80 €
DEUTSC ANN 2.125%22	2 500 000	2 707 814,96 €
DEUTSCH 1625 0833	5 410 000	5 597 885,59 €
DEUTSCH BK AG 1% 19	4 000 000	4 020 126,03 €
DEUTSCHE 0375 0121	3 400 000	3 316 033,69 €
DEUTSCHE 0625 1224	1 300 000	1 279 490,30 €
DEUTSCHE 3600 190127	2 625 000	2 159 085,26 €
DEUTSCHE 4% 31/12/99	7 800 000	8 403 398,09 €
DEUTSCHE B 1.5 0122	14 300 000	14 297 871,10 €
DEUTSCHE W 1.375% 20	5 764 000	5 986 180,90 €
DEUTSCHLAND 050 0226	7 390 000	7 653 032,35 €
DEVON ENGY 3.25% 22	559 000	472 074,23 €
DH EUROP FN 170 0122	1 723 000	1 822 710,12 €
DH EUROPE 1% 07/19	2 330 000	2 371 522,26 €
DH EUROPE 1200 0627	3 780 000	3 753 951,38 €
DIAGEO CAP LIB24 20	2 525 000	2 170 386,90 €
DIAGEO FIN 1.125% 19	3 950 000	3 993 395,35 €
DIAMOND FIN 3.48%19	5 639 000	4 853 936,71 €
DIAMOND1 2. 4.42%21	12 095 000	10 517 382,29 €
DIAMOND1 TF 5.45%23	12 400 000	11 140 352,02 €
DIGITAL 3950 0722	5 274 000	4 554 731,49 €
DIGITAL REALTY 3.5 1	10 078 000	8 299 284,00 €
DIGITAL RLTY 2.75 23	410 000	337 671,41 €
DISCO 2950 0323	4 240 000	3 504 033,90 €
DISCO 2200 0919	170 000	144 895,60 €
DISCOV 3350 0223	1 000 000	845 427,75 €
DISCOV BK 3.20 0821	445 000	380 377,71 €
DISCOV FIN 3.95% 24	2 650 000	2 223 462,84 €
DISCOVER 3.85% 2022	3 000 000	2 571 029,08 €
DISCOVER 4.10 0227	940 000	787 336,05 €
DISCOVER BK 8.7%19	506	465 827,27 €
DISCOVERY 380 130324	250 000	212 423,69 €
DISCOVERY 4.90%16-26	440 000	390 851,92 €
DISCOVERY 5.625%19	1 491	1 339 304,43 €
DISCOVERY CM 3.95 28	9 110 000	7 457 172,58 €
DKE BANK 0250 1122	9 260 000	9 203 787,18 €
DNB 1125 0328	9 700 000	9 539 965,53 €
DNB BANK A 2.125 20	4 000 000	3 355 339,05 €
DNB BANK ASA	3 500 000	3 505 424,21 €
DNB BK 1125 0323	5 000 000	5 180 237,09 €
DOLLAR GL 3.25% 2023	6 743 000	5 706 278,07 €
DOLLAR TRE 3700 0523	3 000 000	2 564 024,38 €
DOLLAR TREE 4 25	4 475 000	3 773 987,14 €
DOLLAR TREE 4.2 28	7 930 000	6 614 208,41 €
DOMINION 1.6%16-2019	1 125 000	953 788,92 €
DOMINION RES 5.2%19	2 255	2 013 562,78 €
DONG A/S 4.875 0718	1 700 000	1 781 875,73 €
DOW CHEMI 3.5% 1024	2 645 000	2 224 048,31 €
DQUSN LGHT 3.616 27	1 000 000	824 099,66 €
DREAM GLBAL 1.375 21	5 000 000	5 078 279,45 €
DT PFAND 2875 280627	2 700 000	2 605 051,36 €
DT PFANDBRIEFBAN	5 600 000	5 577 134,91 €
DUKE REALTY	2 000 000	1 694 117,31 €
DUPONT E 2200 010520	3 025 000	2 561 926,38 €
DVB BANK 1 07/19	900 000	915 243,09 €
DVB BANK 1250 220420	2 800 000	2 844 542,83 €
DVB BK 2375 021220	1 000 000	1 054 773,49 €
E.ETAT 3.75%05 OAT	702 198 690	791 342 210,51 €
E.ETAT 8.5%92 OAT	723 400 593	1 039 380 954,20 €
E.ON SE 0.375 0821	4 482 000	4 517 798,30 €
E.ON SE 0.875 0524	1 400 000	1 409 442,51 €
EASTMAN CHEMI 3.6%22	4 624 000	3 999 598,61 €
EASTMAN CHMC 2.8% 25	2 175 000	1 864 030,23 €
EASTMN CHM 2.70 20	4 170 000	3 591 689,52 €
EASYJET 1.75 23	2 500 000	2 621 007,28 €

EATON 2.75%2022	2 200 000	1 837 782,87 €
EBAY 2.6%12-2022	4 000 000	3 339 071,84 €
EBAY INC 2150 050620	1 525 000	1 283 847,71 €
EBAY INC 2200 010819	2 000 000	1 713 826,20 €
ECOLAB 2.625% 2025	2 966 000	3 363 490,90 €
EDENRED 1875 0327	2 000 000	2 055 714,27 €
EDF 1% 13/10/2026	7 000 000	6 871 896,36 €
EDF 1,625% 271125	6 200 000	6 554 097,37 €
EDF 1.875% 36	2 100 000	1 917 369,03 €
EDF 4.25% 49	8 000 000	8 454 928,36 €
EDF 5 5/8%33	1 188	1 702 872,74 €
EDF 5% 14-2049	3 000 000	3 200 950,74 €
EDF 5.375% 2049	3 100 000	3 394 878,64 €
EDISON INC 2% 0521	2 700 000	2 234 479,04 €
EDP FIN 1.125% 2024	3 400 000	3 386 478,17 €
EDP FINA BV 1.5 1127	5 330 000	5 134 208,18 €
EDP FINANC 4.875% 20	6 000 000	6 854 534,40 €
EDP SA 2375 160975	3 400 000	3 712 566,66 €
EL PASO 6.5% 2020	2 525 000	2 334 968,10 €
EL PASO OP 6.50% 20	5 328 000	4 867 694,71 €
ELISA OY 0875 170324	850 000	850 670,68 €
ELM BV 3375 290947	3 600 000	3 694 655,21 €
ELY LILLY 1.625% 26	1 800 000	1 894 921,63 €
EMBRAER NL 5.05% 25	3 250 000	2 817 608,45 €
ENABLE MIDS 4.4 0327	3 415 000	2 809 773,84 €
ENABLE MIDSTRM	3 850 000	3 190 268,51 €
ENABMIDST 4.95 0528	1 650 000	1 388 353,72 €
ENAGAS FIN 1.25% 25	2 000 000	2 045 401,29 €
ENBRIDGE I 4.25 26	1 813 000	1 540 910,68 €
ENBRIE INC 2.9 07/22	355 000	298 480,13 €
ENBW 3.625% 14-2076	1 415 000	1 486 969,85 €
ENCANA C 3.9 1121	3 000 000	2 594 407,09 €
ENEL 2875 0522	5 300 000	4 349 239,89 €
ENEL 3625 0527	2 425 000	1 914 528,49 €
ENEL 1125 0926	12 500 000	11 878 423,53 €
ENEL 4875 0628	1 325 000	1 142 939,46 €
ENEL FIN 1.966% 2025	3 208 000	3 337 112,35 €
ENEL SPA 2500 1178	3 600 000	3 395 771,37 €
ENEL TF/TV 01/74	500 000	530 763,15 €
ENERGIE B 3.375 0477	2 341 000	2 459 143,37 €
ENERGY 6050 010641	2 120 000	1 813 803,00 €
ENERGY TRAN 4.15%20	2 000 000	1 750 872,43 €
ENEXIS HOLD 0.875%26	2 600 000	2 587 304,70 €
ENEXIS HOLDG 1,50%23	4 290 000	4 542 783,31 €
ENGIE	16 400 000	15 383 215,68 €
ENGIE 2000 0937	4 900 000	4 940 023,09 €
ENI 0.625% 16-2024	5 500 000	5 358 525,06 €
ENI 4.25%12-03/02/20	2 399 000	2 598 206,37 €
ENI SPA 0.75% 22	2 536 000	2 564 194,37 €
ENI SPA 1 140325	1 800 000	1 781 920,79 €
ENI SPA 1.125% 2028	6 700 000	6 276 113,04 €
ENI SPA 1.50% 26	2 132 000	2 141 371,59 €
ENI SPA 1500 170127	3 419 000	3 401 595,97 €
ENI SPA 2.625% 2021	3 004 000	3 278 696,49 €
ENI SPA 3.25% 2023	600 000	691 182,55 €
ENI SPA 4.125%09-19	43	2 324 998,55 €
ENLINK MD4.40%04/ 24	2 480 000	2 058 523,08 €
ENT PRODT TF/TV 66	1 951 000	1 695 258,19 €
ENTER PR L3M 0278	4 572 000	3 660 788,19 €
ENTER PRODU 5.20% 20	10 270	9 294 433,32 €
ENTERGY 5.59% 24	1 000 000	954 190,88 €
ENTERGY 4% 15-2022	5 605 000	4 942 638,20 €
ENTERGY AR 3.5 04/26	1 620 000	1 377 495,27 €
ENTERGY CO 2.95 0926	475 000	375 682,35 €
ENTERGY MISS 2.85 28	1 125 000	882 977,17 €
ENTERP PROD 3.75% 25	1 350 000	1 160 007,92 €

ENTERPRISE 5.25%2020	5 230	4 721 278,30 €
ENTERPRISE O 6.5 119	1 378 000	1 236 553,03 €
ENTERPRISE PRODU	2 700 000	2 388 119,99 €
EP INFRASTRUCTUR	3 720 000	3 604 583,43 €
EQUIFAX 3300 1222	7 930 000	6 661 729,78 €
EQUINIX 5.875%0126	3 500 000	3 092 868,25 €
ERAC USA 3.85% 2024	2 300 000	1 975 991,32 €
ERAC USA FINANCE	5 980 000	4 989 954,73 €
ERP OPERA 2.85 11/26	2 450 000	1 948 686,07 €
ERSTE GRP 1.875% 19	2 300 000	2 345 263,68 €
ERSTE GRP 7.125%2022	5 900 000	7 603 874,92 €
ESB FINAN 1.75 0229	4 861 000	5 014 656,21 €
ESB FINAN 3.494% 24	3 574 000	4 170 518,03 €
ESSEX 3250 0523	3 000 000	2 513 024,43 €
ESSEX PORT 3.62 22	2 000 000	1 727 781,83 €
ESSILOR 1,75% 090421	2 500 000	2 615 837,11 €
ETP 6.50% 2042	2 490 000	2 267 593,23 €
ETP 9% 15/04/2019	1 222	1 113 767,36 €
EURO INVS 2.625 0448	2 900 000	2 878 131,62 €
EUROC INVS 1.5 0430	4 500 000	4 510 984,32 €
EUROCLEAR 1.125 -26	5 300 000	5 361 425,20 €
EUROGRID 3.875% 2020	38	2 116 681,80 €
EURONEXT NV 1% 0425	4 901 000	4 928 464,67 €
EUTELSAT 1.125% 21	3 000 000	3 052 394,15 €
EVERYTH 3.25%2018	5 880 000	6 071 039,59 €
EVONIK 2125 071122	4 600 000	4 614 395,99 €
EVONIK FIN 0.75 0928	2 250 000	2 095 889,48 €
EXELON 2.85% 20	1 100 000	935 110,70 €
EXELON 3497 0622	1 295 000	1 099 431,14 €
EXELON 4% 10-2020	1 850	1 621 611,59 €
EXELON COR 3.95 25	4 175 000	3 554 426,69 €
EXELON CORP 2.45% 21	105 000	87 885,80 €
EXOR SPA 2.125% 22	1 500 000	1 592 116,18 €
EXOR SPA 2.5%10/24	2 500 000	2 679 921,91 €
EXPE 1375 0626	4 900 000	4 902 593,91 €
EXPEDIA 2.50% 22	5 100 000	5 393 287,20 €
EXPEDIA 5.95 20	3 700 000	3 397 162,29 €
EXPEDIA INC 3.8 28	4 950 000	3 932 936,92 €
EXPRESS 3500 0624	3 350 000	2 749 436,00 €
EXPRESS 4.75% 2021	2 000 000	1 776 289,38 €
EXPRESS SCRIPTS 3%23	4 375 000	3 606 906,56 €
EXPRESS SCRPT 4.5%26	3 450 000	2 979 224,45 €
EXXON 2.222% 16-2021	9 025 000	7 643 210,78 €
EXXON MOBI3.043 0326	2 700 000	2 269 411,55 €
FASTIGHET 3000 0678	2 250 000	2 172 754,42 €
FAURECIA 2625 0625	5 150 000	5 200 997,88 €
FAURECIA 3625 0623	2 850 000	2 960 558,63 €
FCA BANK IE 1%1121	8 000 000	8 060 140,56 €
FCA BK I Eurib3 21	5 052 000	4 987 555,43 €
FCA BK IRL 0.25 20	3 550 000	3 530 856,69 €
FCA CAP IRE 1.25% 20	3 473 000	3 560 148,96 €
FCA CAPI 1.375% 20	4 353 000	4 424 240,27 €
FCA CAPI 1250 210121	900 000	915 213,59 €
FCC AQ 1413 0622	1 449 000	1 475 936,78 €
FCC AQUA 2.629 0627	2 070 000	2 084 436,98 €
FCE BANK 1.875% 21	7 421 000	7 719 688,04 €
FCE BANK 0869 0921	1 948 000	1 976 472,96 €
FCE BANK 1.528 1120	1 240 000	1 290 551,54 €
FCE BANK 1660 110221	1 500 000	1 560 382,92 €
FCE BANK PL 1615 523	1 500 000	1 532 986,45 €
FEDEX 3.25%16-2026	500 000	412 836,95 €
FERR 2124 0523	1 200 000	1 085 315,51 €
FERROVEMIS 2.5 24	100 000	109 754,81 €
FERROVIAL EMISIO	5 100 000	5 068 472,80 €
FERROVIE 1500 0625	2 000 000	1 970 779,95 €
FGA CAPITAL 2% 19	1 930 000	1 999 254,60 €

FIDELI NATIO 2.25%21	3 061 000	2 545 921,97 €
FIDELITY 3.625% 2020	2 510 000	2 181 411,90 €
FIDELITY 3.875% 2024	1 669 000	1 427 379,02 €
FIDELITY 4.50% 2022	644 000	574 373,76 €
FIDELITY NAT 4.25 28	290 000	248 758,08 €
FIDELITY NATL 3.5%23	817 000	695 426,74 €
FIFTH 2200 1020	3 750 000	3 149 704,51 €
FIRST AMERIC 4.60%14	2 900 000	2 521 720,41 €
FIRST HORIZ 3.5 1220	745 000	639 479,34 €
FIRST RP BK 2.375%19	905 000	770 418,94 €
FLA GAS 5.45%0720	1 000 000	911 133,00 €
FLEXTRONICS 5%2023	2 890 000	2 573 850,43 €
FLYON 1500 0525	2 600 000	2 593 520,43 €
FMGRES080 5.125 24	2 000 000	1 665 921,52 €
FONCIERE REGIONS	7 800 000	7 561 598,07 €
FONTERRA 0750 081124	3 100 000	3 044 509,58 €
FOR MO CR E3M 1123	2 300 000	2 273 937,61 €
FORD 3815 1127	1 170 000	934 561,30 €
FORD M +127 280322	8 210 000	7 122 253,45 €
FORD M C LIB3M 23	2 155 000	1 864 462,95 €
FORD MOT 3157 0820	2 450 000	2 110 973,29 €
FORD MOTO 2681 0120	2 600 000	2 234 920,33 €
FORD MOTOR 2.59 19	6 375 000	5 437 580,39 €
FORD MOTOR 3096 0523	8 050 000	6 601 158,58 €
FORD MOTOR 4.25% 22	1 325 000	1 155 917,63 €
FORD MOTOR 4.375%23	1 135 000	995 563,40 €
FORD MOTOR 4.389% 26	1 000 000	859 051,36 €
FORD MOTOR 5.875%21	2 000 000	1 856 455,59 €
FORD MTR 4.346 26	1 770 000	1 485 945,06 €
FORTIS INC 2.1 21	1 925 000	1 580 281,75 €
FORTIVE 2.35%17-2021	3 450 000	2 865 504,90 €
FRA 0000 0323	30 000 000	30 235 506,00 €
FRESN 3000 0132	4 580 000	4 887 412,96 €
FRESNS 2875 0720	2 596 000	2 739 614,35 €
FRTEL 4.125% 2019	1 300 000	1 354 580,77 €
FS INVS CP 4.25 0120	2 450 000	2 145 359,66 €
FTB MEMPHI 2.95 19	7 825 000	6 675 878,24 €
G4S 1875 0525	7 715 000	7 791 914,65 €
G4S PLC 2.625% 18	920 000	944 104,76 €
GAI BOND IS 3.4 926	2 042 000	1 650 448,33 €
GALP GAS 1.375% 2023	3 900 000	3 978 204,53 €
GAS 1500 0128	700 000	686 262,12 €
GAS N 1125 0424	2 300 000	2 320 993,75 €
GAS NAT 1875 1029	1 000 000	1 009 669,86 €
GAS NAT FENOSA F	4 000 000	3 887 573,83 €
GDF SUEZ 2.375% 2026	4 200 000	4 632 577,24 €
GDF SUEZ 3% 2049	11 900 000	12 110 249,73 €
GDF SUEZ 3.875% 49	5 000 000	5 190 034,25 €
GDYEAR DTE 3.75 23	1 000 000	1 024 395,00 €
GE 4.65% 2021	1 645	1 475 740,16 €
GE CAP 2.625% 2023	1 900 000	2 082 376,74 €
GE CAP EUR FD 0.8%22	7 510 000	7 651 217,31 €
GE CAP IN 3.373 1125	1 500 000	1 237 806,52 €
GE CAPIT2.342% 20	16 005 000	13 418 300,66 €
GECINA 1.375 06/27	2 700 000	2 669 357,20 €
GECINA 1.5% 2025	4 600 000	4 746 850,98 €
GECINA 1.625 30	3 600 000	3 492 960,77 €
GECINA 2% 24	1 200 000	1 275 458,65 €
GELF BOND 1.75% 21	1 001 000	1 053 794,52 €
GELF BOND 0.875% 22	1 110 000	1 124 815,15 €
GEN 4150 0623	3 530 000	3 023 678,75 €
GEN 4350 0425	1 045 000	893 505,36 €
GEN ELEC 0.375 05/22	5 056 000	5 046 421,80 €
GEN ELECT 0.875 0525	5 365 000	5 271 153,34 €
GEN ELECT 1.875 % 27	6 000 000	6 182 023,30 €
GEN ELECT 2.125 0537	6 110 000	5 701 138,97 €

GEN ELECTR 1.5 05/29	1 229 000	1 188 625,02 €
GEN ELECTRI 1.25% 23	18 960 000	19 435 502,96 €
GEN ELECTRIC 2.7%22	3 325 000	2 766 310,01 €
GEN ELECTRIC 5%2021	2 722 000	2 303 447,76 €
GEN MILLS 3.20 21	255 000	218 750,18 €
GEN MILLS 4.20 28	215 000	181 401,89 €
GEN MOT 4200 010321	2 080 000	1 830 345,36 €
GEN MOT FIN L3M 0421	500 000	432 447,18 €
GEN MOTORS 3.2% 20	8 780 000	7 594 251,51 €
GEN MOTORS 3.2% 21	4 130 000	3 545 575,50 €
GEN MOTORS 3.55 21	2 165 000	1 864 554,85 €
GEN MOTORS 3.7 0523	9 505 000	8 032 703,95 €
GEN MOTORS 3950 0424	1 075 000	909 146,60 €
GEN MOTORS F 1 0520	3 664 000	3 740 829,68 €
GEN MOTORS FIN	435 000	368 595,32 €
GEN MOTORS FIN	2 210 000	1 837 358,85 €
GENERAL MIL 2.1% 20	300 000	316 951,54 €
GENERAL MILLS 3.7 23	4 705 000	4 011 716,65 €
GENERAL MILLS IN	4 767 000	4 056 877,84 €
GENERAL MTRS 4.2 27	1 885 000	1 561 396,64 €
GENMOTFIN 4.375% 21	4 365 000	3 852 923,21 €
GENMOTFIN 5.25%2026	7 650 000	6 896 247,92 €
GILEAD 2.35%02/20	1 650 000	1 413 105,79 €
GILEAD SCIE 2.5 0923	1 720 000	1 414 423,55 €
GILEAD SCIE 3.25% 22	3 455 000	2 970 030,18 €
GILEAD SCIE 3.5% 25	1 700 000	1 454 275,38 €
GILEAD SCIE 3.65% 26	1 160 000	992 032,68 €
GILEAD SCIENCES	3 000 000	2 596 271,40 €
GLAX 0000 0920	12 536 000	12 552 679,15 €
GLAXO 1000 0926	4 000 000	4 023 599,18 €
GLAXOS 1250 210526	8 940 000	9 131 349,99 €
GLAXOS 1750 210530	1 418 000	1 460 015,69 €
GLAXOSM 3.125 0521	7 000 000	6 021 400,94 €
GLAXOSM 3.625 0525	7 000 000	6 012 327,81 €
GLAXOSMITH. 4%25	584	708 271,65 €
GLD SACHS LIB117 26	2 705 000	2 296 584,99 €
GLEN F LC 3.875 1027	2 300 000	1 846 055,91 €
GLENCORE FI 1.75% 25	1 740 000	1 733 966,17 €
GLENCORE FI 3.375%20	3 000 000	3 284 335,94 €
GLPFI 4375 0421	3 355 000	2 892 472,84 €
GOLD SACH 5% 11/22	2 470 000	2 002 912,03 €
GOLD 3200 0620	2 690 000	2 312 727,50 €
GOLD L3M 0529	3 535 000	2 998 282,48 €
GOLD M L3US 06/28	5 985 000	4 866 331,09 €
GOLD SACHS 2.75% 20	2 350 000	2 004 529,57 €
GOLD SACHS 3.5% 25	3 840 000	3 217 784,03 €
GOLD SACHS 4.25% 25	9 755 000	8 279 572,44 €
GOLDCORP 3.70%13-23	1 700 000	1 448 716,54 €
GOLDM SA L3MUS 0623	16 820 000	13 928 982,32 €
GOLDM SACH 3.75 0226	755 000	634 297,86 €
GOLDMA 3000 260422	1 425 000	1 198 698,13 €
GOLDMA E3M 1220	2 400 000	2 398 137,00 €
GOLDMAN 2.875% 2026	800 000	878 068,73 €
GOLDMAN 1.625% 2026	1 300 000	1 325 109,90 €
GOLDMAN 2.125% 24	5 500 000	5 904 175,71 €
GOLDMAN 2.625% 2019	6 500 000	5 623 866,76 €
GOLDMAN 2.625% 21	3 200 000	2 691 525,56 €
GOLDMAN 2300 131219	1 805 000	1 531 606,82 €
GOLDMAN 5.125% 10/19	104	5 733 273,90 €
GOLDMAN 5.75%12-2022	3 090 000	2 895 757,37 €
GOLDMAN S 1.375 0524	12 306 000	12 450 480,93 €
GOLDMAN SA 3.85 0127	12 025 000	10 070 393,22 €
GOLDMAN SACH 2.55%19	2 000 000	1 710 707,61 €
GOLDMAN SACHS 3.2 23	2 600 000	2 198 475,25 €
GOLDMAN SACHS 4% 24	9 370 000	8 124 652,59 €
GOLDMAN SACHS GP	720 000	601 573,81 €

GOOD AU F 1.375 0925	2 057 000	2 029 386,16 €
GOODYEAR 5.125% 2023	3 000 000	2 561 269,32 €
GROUPAMA E3M 1299	2 000 000	2 227 291,54 €
GRUPO TE 4625 300126	2 785 000	2 429 575,87 €
GRUPO-ANTO 3250 0424	300 000	290 762,25 €
GSACHS G 0.75 19	1 927 000	1 942 627,18 €
GSACHS G 2% 16-2019	2 300 000	1 962 900,00 €
GSACHS G 2.50% 21	500 000	543 697,52 €
GSACHS G 2.60 20	5 500 000	4 683 093,28 €
GSACHS G 2.625% 2020	5 621 000	6 047 259,90 €
GSACHS G 3.25% 23	1 900 000	2 132 878,34 €
GSACHS G 3.50 26	1 000 000	809 429,52 €
GSACHS G 7.5 19	4 000 000	3 621 532,27 €
GSACHS G Eurib3 23	1 000 000	987 387,75 €
GUARDIAN LIFE	6 253 000	5 210 517,94 €
HALLIBURT 3.8% 1125	1 551 000	1 322 745,97 €
HAMMERSON 2% 22	2 250 000	2 363 048,08 €
HANNOVE R 1.125 0428	3 200 000	3 145 164,37 €
HANNOVER 3.375% 49	3 800 000	3 939 131,14 €
HARRIS C 4.40 28	2 695 000	2 325 828,37 €
HARRIS C 4854 270435	1 250 000	1 106 300,59 €
HASBRO 3.5% 09-2027	2 380 000	1 905 671,53 €
HCA INC 3.75%14-2019	5 195 000	4 500 167,92 €
HCA INC 4.75%12-2023	2 900 000	2 494 962,62 €
HCA INC 5250 150626	1 825 000	1 555 028,80 €
HDLBRG LUX 1.50 27	6 723 000	6 576 250,51 €
HEALTH CARE 4.50%24	2 000 000	1 775 221,62 €
HEALTHCARE 3.5%26	1 550 000	1 266 986,48 €
HEATHROW 1.875% 2022	3 000 000	3 161 723,59 €
HEIDEBGCMNT 2.25%24	2 050 000	2 183 081,93 €
HEIDEL 1750 240428	6 330 000	6 265 800,91 €
HEIDELCE 1.625 0426	10 035 000	10 145 325,67 €
HEINEKEN 1% 16-2026	16 100 000	15 982 605,82 €
HEINEKEN 1500 1029	2 900 000	2 915 560,76 €
HEINEKEN 2.5%12-2019	3 818 000	3 915 512,77 €
HEINEKEN NV 1.50% 24	2 000 000	2 099 755,89 €
HEINEKEN NV 2% 21	3 700 000	3 919 304,25 €
HELLA FINANCE 1% 24	800 000	810 054,14 €
HEMSO FAST 1.75 0629	3 900 000	3 825 865,81 €
HERA SPA 0875% 26	600 000	566 334,49 €
HERA SPA 2.375% 24	200 000	219 128,55 €
HESS 5800 0447	580 000	518 034,42 €
HEWLETT CO 2.85 18	1 189 000	1 025 863,63 €
HIGHMARK 6.125 0541	3 000 000	2 795 589,05 €
HIT SAS 0.625 23	1 900 000	1 867 605,16 €
HLDG D'INFRA 2.25%25	2 000 000	2 093 084,85 €
HOCHTIEF 1750 030725	4 400 000	4 387 680,00 €
HOLCIM FIN 3% 2024	4 140 000	4 592 788,36 €
HOME 2800 0927	8 080 000	6 496 510,86 €
HOME DEPOT 2 0619	6 500 000	5 538 152,54 €
HOME DEPOT 3%16-2026	2 025 000	1 670 898,89 €
HOST H&R 6% 10/21	775 000	717 691,17 €
HOST HOTELS 3.75%23	2 950 000	2 490 843,00 €
HOWARD HUGHES 3.5%23	3 900 000	3 415 589,34 €
HP ENTERPR 2.10 1019	2 500 000	2 124 944,69 €
HP ENTERPR 3.6 10/20	1 380 000	1 196 500,36 €
HSBC 3.90 05/26	5 100 000	4 281 486,87 €
HSBC 4% 30/03/2022	2 000 000	1 751 622,35 €
HSBC 5.1% 05/04/2021	5 000	4 521 076,90 €
HSBC BANK 3% 06 2025	2 081 000	2 235 682,76 €
HSBC FR 1.625% 12/18	4 800 000	4 882 312,11 €
HSBC FRANCE	3 700 000	3 728 267,73 €
HSBC HG E3M05 1023	3 250 000	3 228 209,47 €
HSBC HLD 3.262% 0323	12 077 000	10 236 484,25 €
HSBC HLD E3M70 0922	9 673 000	9 710 073,39 €
HSBC HO 4,375 231126	690 000	582 737,59 €



HSBC HOL 0875 060924	17 425 000	17 324 361,58 €
HSBC HOL 4.041 03/28	6 875 000	5 799 822,54 €
HSBC HOLD 1.50% 22	6 859 000	7 108 964,93 €
HSBC HOLD 3.375% 24	8 200 000	8 465 098,14 €
HSBC HOLD 6% 27	600 000	481 106,59 €
HSBC HOLD L3M 0524	3 925 000	3 364 690,33 €
HSBC HOLD L3M 1123	2 790 000	2 313 137,73 €
HSBC HOLDI 2.65 0122	3 000 000	2 517 972,10 €
HSBC USA 5% 27/09/20	1 225	1 093 831,81 €
HSBCH LIBUS 0524	1 605 000	1 374 356,48 €
HUMANA INC 3.95 0327	2 800 000	2 382 596,03 €
HUNT 5700 0423	1 750 000	1 506 157,12 €
HUNTINGT 4000 150525	830 000	714 589,33 €
HUNTINGTON 3.15 0321	2 000 000	1 718 568,80 €
HUNTSM 425 25	1 799 000	2 066 027,57 €
HUNTSM 5125 150421	6 801 000	7 604 634,50 €
HUNTSMAN 5125 1122	2 978 000	2 635 023,91 €
HUSKY ENE 3950 0422	7 000 000	6 100 670,92 €
HYUNDAI LIBUS 030420	4 000 000	3 431 424,78 €
IBER 1000 0324	2 200 000	2 229 672,89 €
IBERDR 1250 1026	2 000 000	1 983 362,47 €
IBERDR IN 1.875 0523	2 900 000	2 770 509,25 €
IBERDROLA 2.875% 20	7 500 000	8 133 395,30 €
IBERDROLA 1.125%2026	2 200 000	2 177 518,64 €
IBERDROLA 2625 1299	900 000	885 480,72 €
IBERDROLA 3% 22	9 600 000	10 631 667,29 €
IBERDROLA F 1.621 29	1 000 000	998 183,97 €
IBERDROLA IN 3.5% 21	2 500 000	2 750 769,86 €
IBM 0.95 23/05/25	12 000 000	12 023 459,08 €
IBM CO 1800 170519	1 650 000	1 405 782,19 €
IBM CORP 1.125% 24	2 400 000	2 477 259,78 €
IBM CORP 1500 230529	2 000 000	2 024 712,66 €
ICADE 1,125% 171125	3 300 000	3 276 174,98 €
ICADE 1.50 130927	2 300 000	2 287 994,45 €
ICAHN 5875 0222	2 050 000	1 799 139,13 €
ICAHN EFLC 6.25 22	2 000 000	1 784 127,26 €
IE2 HOLD 2875 010626	2 400 000	2 561 002,92 €
IGD 2.5% 31/05/2021	1 000 000	1 023 250,27 €
ILL TOOL 1.75% 22	2 361 000	2 497 664,10 €
IMCOL 1625 1125	1 400 000	1 379 477,62 €
IMCOL 2500 1129	2 500 000	2 508 982,54 €
IMERYS 2.5% 13-2020	3 100 000	3 311 203,00 €
IMERYS SA 0.875%22	4 100 000	4 182 916,04 €
IMMO 2728 0623	2 000 000	2 161 298,02 €
IMS HEA INC 5 1026	3 000 000	2 530 743,87 €
IN GRP NV 1.125 225	14 400 000	14 285 586,92 €
INEOS FIN 4 05/23	1 000 000	1 023 378,89 €
INFRA PK 1625 190428	3 000 000	2 966 581,32 €
ING 1375 0128	1 300 000	1 277 796,34 €
ING 2.50 01/10/19	1 500 000	1 282 851,55 €
ING BANK 1.25% 2019	4 120 000	4 229 638,59 €
ING BANK 3.625% 26	1 500 000	1 626 883,09 €
ING BANK 4.5% 2022	5 000 000	5 853 637,87 €
ING BANK NV 3.50% 23	4 159 000	4 300 902,80 €
ING BK 5.80% 23	4 075 000	3 744 019,07 €
ING GP NV 1625 0928	12 300 000	12 085 952,35 €
ING GROEP 0750 0322	5 300 000	5 346 471,79 €
ING GROEP 2.50 0229	3 800 000	3 932 878,61 €
ING GROEP 3.15 22	8 748 000	7 396 445,05 €
ING GROEP 3.95 27	380 000	321 273,85 €
ING GROEP NV	4 810 000	4 182 634,59 €
ING GROUP 3000 0418	2 300 000	2 455 224,97 €
INGER 3750 0828	4 245 000	3 572 446,28 €
INMOBILIA 2% 0426	3 700 000	3 661 772,26 €
INMOBILIARIA 1.45%24	13 400 000	13 392 476,64 €
INNOGY 0.75% 301122	775 000	784 581,81 €

INNOGY 1500 310729	17 150 000	16 722 520,31 €
INNOGY F 1250 191027	4 117 000	4 059 953,90 €
INNOGY FI 1.625% 300	3 237 000	3 322 015,59 €
INNOGY FI 1000 0418	2 300 000	2 295 323,13 €
INT LEASE 5.875%2019	3 150 000	2 789 158,71 €
INT PAPER 3.80% 2026	3 900 000	3 301 491,16 €
INTE SANPA 1.75 0328	5 996 000	5 417 123,06 €
INTEL 3.70% 2025	2 065 000	1 810 096,66 €
INTEL CO 3300 011021	1 550 000	1 348 811,76 €
INTEL CORP 2.7% 22	1 600 000	1 342 270,57 €
INTERCONT 2.35 15092	9 570 000	7 904 440,50 €
INTESA 0875 0622	5 050 000	4 947 750,31 €
INTESA E3M 0422	1 750 000	1 712 595,21 €
INTESA SA 4.375%2019	6 000 000	6 465 914,68 €
INTESA SAN 1.125% 22	6 050 000	6 003 049,29 €
INTESA SAN 4% 23	8 918 000	10 136 013,34 €
INTESA SANP 2% 21	11 040 000	11 340 122,59 €
INTESA SANP 4.75% 24	1 300 000	1 314 075,26 €
INTESA SANP 5.25% 24	2 700 000	2 319 790,37 €
INTESA SANPA 3.5% 22	3 400 000	3 702 189,28 €
INTL LEASE 6.25 19	1 817 000	1 608 514,34 €
INTL LS FIN 5.875 22	2 000 000	1 853 849,23 €
INTL PAPER 3%16-2027	2 400 000	1 882 218,32 €
INTRUM 2.75 15/07/22	2 990 000	2 871 725,56 €
IREN SPA 1500 241027	5 378 000	5 127 385,01 €
IRON MOUNT 6% 0823	1 625 000	1 459 208,39 €
ISS GLOBA 1.125% 21	4 000 000	4 102 442,72 €
ISTAR 5250 0922	2 275 000	1 925 512,61 €
ITALGAS 1125 0324	10 350 000	10 315 477,91 €
ITC HOLD 2700 1122	1 775 000	1 468 010,36 €
JAB 2500 0629	6 000 000	6 039 483,87 €
JAB HOLD 1.75% 23	3 000 000	3 123 097,09 €
JAB HOLDINGS	4 000 000	3 957 221,00 €
JABHG 1750 0626	7 500 000	7 486 561,22 €
JACKS 3875 0625	4 000 000	3 432 925,54 €
JAGUAR LR 4.5 27	1 750 000	1 347 659,63 €
JC DECAUX 1%16-2023	3 500 000	3 559 379,64 €
JOHN DE B E3M 1022	2 796 000	2 793 511,56 €
JOHN DEERE 2.8 0323	2 815 000	2 369 730,68 €
JOHNSON 0000 1220	2 278 000	2 270 469,16 €
JOHNSON 1% 150923	6 500 000	6 580 820,37 €
JOHNSON&JOHN 1.65%35	7 000 000	7 210 154,29 €
JP MORGAN 4.5%12-22	22 820 000	20 589 208,42 €
JPM 2604 0221	2 125 000	1 823 043,91 €
JPM 4.625% 2021	7 500	6 684 118,63 €
JPMO CH L3M 01/02/28	12 795 000	10 842 883,81 €
JPMORG CHASE 4.4%20	2 260 000	2 019 178,09 €
JPMORGA 1638 1805828	11 869 000	11 962 271,69 €
JPMORGAN 1.375% 21	4 629 000	4 841 779,66 €
JPMORGAN 1.5% 25	2 120 000	2 190 149,43 €
JPMORGAN 2.625% 21	14 070 000	15 099 684,31 €
JPMORGAN 0000 0528	3 585 000	2 951 477,54 €
JPMORGAN 0625 250124	17 940 000	17 708 288,81 €
JPMORGAN 1.50% 2022	1 400 000	1 472 616,70 €
JPMORGAN 1.875%2019	6 000 000	6 235 593,89 €
JPMORGAN 2.295% 2021	11 250 000	9 400 911,63 €
JPMORGAN 2.55% 20	3 100 000	2 623 970,13 €
JPMORGAN 2.95% 2026	7 485 000	5 981 453,79 €
JPMORGAN 2750 230620	3 000 000	2 548 089,31 €
JPMORGAN 3.20%2023	6 250 000	5 333 253,63 €
JPMORGAN 3.875% 2024	6 900 000	5 907 525,19 €
JPMORGAN 3559 230424	10 000 000	8 534 026,62 €
JPMORGAN 4125 1226	5 800 000	4 904 590,38 €
JPMORGAN 6.75% 49	2 000 000	1 908 081,02 €
JPMORGAN 6000 0823	2 100 000	1 881 291,59 €
JPMORGAN Ch 4.95 320	4 760 000	4 252 770,84 €

JPMORGAN CHASE	2 128 000	1 752 860,25 €
JPMORGAN CHASE	3 400 000	3 434 461,79 €
JPMORGAN CHS 5.15 23	2 185 000	1 860 154,37 €
KAISER F 3150 010527	3 035 000	2 501 707,70 €
KAISER HOSP 3.5% 22	700 000	608 206,17 €
KANSAS CITY SOUT	920 000	776 283,90 €
KBC GP 0875 0623	7 800 000	7 777 140,04 €
KBC GP NV 1.625 0929	3 000 000	2 958 082,85 €
KBC GROEP 2.375% 24	6 200 000	6 459 507,63 €
KBC GROEP 1%16-2021	8 200 000	8 348 608,72 €
KBC GROEP TV 311299	9 980 000	10 164 928,86 €
KBC GRP 0750 010322	4 300 000	4 315 239,39 €
KBC GRP 0750 181023	3 000 000	2 972 889,51 €
KERING	3 600 000	3 666 077,69 €
KERR-MCGEE CORP	7 400 000	7 207 235,00 €
KEY BANK 1.60 08/19	2 100 000	1 781 734,97 €
KEY BANK NA	1 500 000	1 275 671,28 €
KEY BK 3400 200526	3 327 000	2 720 702,98 €
KEYBANK NA 2.25% 20	12 500 000	10 625 214,12 €
KEYCORP	3 600 000	3 082 100,12 €
KEYCORP 2.9 15/09/20	3 500 000	2 997 190,70 €
KILROY 3450 1224	735 000	604 370,76 €
KILROY RE 4.375 1025	2 000 000	1 727 001,94 €
KIMBELY-CL 0625 0924	3 500 000	3 508 143,67 €
KINDER M 4150 010322	7 570 000	6 636 961,36 €
KINDER MORG 1.50% 22	5 000 000	5 171 099,26 €
KINDER MORG 3.95%22	3 975 000	3 449 321,90 €
KINDER MORG 4.30%25	6 120 000	5 237 301,70 €
KINDR MORG 4.25% 24	2 000 000	1 736 478,57 €
KLEPIERRE 1% 2023	5 500 000	5 623 434,79 €
KLEPIERRE 1.62 32	2 900 000	2 783 841,06 €
KNORR 1125 0625	4 200 000	4 206 911,59 €
KOHL'S CORP 5.55 45	1 075 000	916 672,55 €
KON DSM 0.75% 2026	3 700 000	3 639 695,29 €
KONIN PH 1375 020528	5 550 000	5 543 884,54 €
KONINKL 0625 090425	5 500 000	5 287 443,59 €
KONINKLIJKE 6.125 18	1 720 000	1 821 032,80 €
KRAFT FDS 5.375% 24	2 860 000	2 585 600,43 €
KRAFT HEINZ 2.25% 28	4 562 000	4 612 896,46 €
KRAFT HEINZ 3.95% 25	630 000	534 472,53 €
KRAFT HZ 3% 01/06/26	2 850 000	2 204 906,43 €
KRAFT HZ 3.5% 150722	1 280 000	1 100 175,47 €
KROGER 3500 010226	2 750 000	2 275 860,90 €
KROGER CO 3.7 0827	760 000	630 361,09 €
KROGER CO/THE	3 000 000	2 623 585,00 €
LA BQE POS 1.00 24	4 900 000	4 810 190,29 €
LABO CORP 3.25 0924	7 561 000	6 300 351,23 €
LABOR CORP 2 03/18	730 000	600 387,56 €
LANDS 1000 0523	3 665 000	3 627 439,27 €
LANXESS 1.125 0525	5 000 000	4 903 106,26 €
LANXESS 4500 1276	1 605 000	1 729 738,62 €
LANXESS AG 1% 26	3 000 000	2 888 010,19 €
IBBW 0,50 070622	4 200 000	4 214 836,35 €
LBP 2.75% 27	1 500 000	1 592 219,10 €
LEAR CORP	1 825 000	1 483 165,17 €
LEASE CORP 2.375% 19	510 000	521 668,73 €
LEASEPL E3M 1120	1 950 000	1 956 587,75 €
LEASEPLAN 0750 1022	5 242 000	5 236 673,02 €
LEASEPLAN 1 240521	2 800 000	2 837 879,77 €
LEASEPLAN 100 020523	5 400 000	5 376 630,04 €
LEASEPLAN CORP	1 700 000	1 730 197,55 €
LEG IMMOBI 1.25 0124	1 000 000	1 015 321,60 €
LEGRA 1000 0326	2 200 000	2 204 554,60 €
LENNAR 4750 1122	1 215 000	1 044 869,13 €
LENNAR CP 4.50 19	3 875 000	3 355 921,59 €
LEVEL 3 5.375 22	1 350 000	1 161 142,99 €

LEVEL 6125 0121	2 300 000	2 007 978,18 €
LEVI STRAUSS CO TV	250 000	252 543,75 €
LEXINGTON 4.40% 2024	1 700 000	1 433 500,92 €
LIBERTY MUTUAL E	4 411 000	4 520 796,54 €
LIBERTY PR 3.75 0425	2 000 000	1 689 183,91 €
LIFEP HEALTH 5.5%21	4 480 000	3 861 532,80 €
LINCO NA CR 3.8 0328	1 145 000	936 611,85 €
LINCOLN NATL CRP	2 495 000	2 054 161,64 €
LLO BK GR 1.75 0928	6 280 000	6 155 536,90 €
LLOY BK GR 3.75 27	1 700 000	1 401 725,26 €
LLOY BKPLC 0625 0124	8 368 000	8 173 397,45 €
LLOYD 2700 0820	2 475 000	2 114 354,42 €
LLOYD 3000 0122	1 400 000	1 184 251,36 €
LLOYD 3574 1128	6 350 000	5 053 021,44 €
LLOYD 4375 0328	1 590 000	1 357 596,63 €
LLOYDS 2907 1123	10 255 000	8 398 656,59 €
LLOYDS 4.582 101225	1 050 000	883 884,42 €
LLOYDS BANK 4.65% 26	2 245 000	1 916 498,94 €
LLOYDS BK 1% 191121	7 000 000	7 213 759,57 €
LLOYDS BK 150 120927	1 700 000	1 677 147,57 €
LLOYDS BK 4.5% 24	2 410 000	2 053 840,99 €
LLOYDS TSB 6500 0320	2 300	2 578 708,71 €
LONDON SE 0175 0929	1 117 000	1 151 043,12 €
LONDON SE 0875 0924	9 958 000	10 007 942,73 €
LOWE'S C 2500 150426	2 375 000	1 869 236,50 €
LTD BRAND 6.625 0421	5 340 000	4 884 601,24 €
LVMH 0750 260524	5 278 000	5 336 856,67 €
LVMH MOET 0.37 22	1 826 000	1 837 862,45 €
LVMH MOET 1% 09/21	4 000 000	4 146 604,11 €
LYB INTL FI 4% 23	1 600 000	1 396 656,82 €
M&S L3M 0728	1 825 000	1 506 564,42 €
MACQ 4150 0324	3 600 000	3 092 342,08 €
MACQU 1250 0325	2 000 000	1 961 144,98 €
MACQUA GP L3M 1123	18 656 000	15 324 755,00 €
MACQUARIE 6.625%2021	1 200 000	1 117 649,50 €
MACQUARIE BK 2.60%19	1 400 000	1 194 871,31 €
MACYSRETAIL 2.875%23	3 600 000	2 931 001,67 €
MAGELLAN HLTH 4.4 24	3 650 000	3 081 826,23 €
MANPOW 1.875 09/2022	4 803 000	5 155 175,70 €
MANPWR INC 1.75 26	1 267 000	1 282 098,08 €
MANUF&TRADER 2.10%20	5 300 000	4 502 855,12 €
MANULIFE FIN4.15% 26	4 100 000	3 553 759,61 €
MAPFRE 1.625% 26	5 700 000	5 707 547,51 €
MAPLE ESC 4.417 25	1 850 000	1 600 236,75 €
MARA PETRO 3.625% 24	4 665 000	3 945 701,79 €
MARAT 4400 0727	1 190 000	1 044 528,95 €
MARATHON OIL 2.8% 22	6 160 000	5 076 056,43 €
MARKEL 3.625%2023	4 000 000	3 405 574,35 €
MARRIOTT 3125 150626	1 000 000	795 676,84 €
MARRIOTT INTL 4 28	5 435 000	4 585 531,53 €
MARRTTINTL 2.30 22	4 155 000	3 451 129,84 €
MARRTTINTL 3.75 25	5 075 000	4 287 999,37 €
MARSH & MCL 3.75 326	1 500 000	1 285 196,57 €
MASCO CORP 3.5 1127	3 000 000	2 376 763,31 €
MASTER 3500 260228	295 000	253 706,12 €
MASTERCARD 1.10 1222	3 200 000	3 324 324,21 €
MASTERCARD 3.375% 24	1 370 000	1 181 581,73 €
MATCH GROUP INC	2 000 000	1 801 390,37 €
MCCO 3150 0824	8 429 000	6 978 877,02 €
MCDONALD'S 1.125%22	5 000 000	5 152 454,67 €
MCDONALD'S 3.70%26	10 070 000	8 687 989,42 €
MCDONALD'S CORP	700 000	591 069,14 €
MCKESSON CORP	3 000 000	2 562 154,94 €
MEAD JOHNSON 3%15-20	2 200 000	1 881 423,49 €
MEDIO SPA 0.625 0922	1 250 000	1 200 383,62 €
MEDIOBA 0750 170220	3 486 000	3 493 037,26 €

MEDIOBA E3M 180522	400 000	387 138,27 €
MEDTRONIC 3.5% 25	6 625 000	5 665 707,04 €
MERCI 1800 0226	5 000 000	4 986 918,50 €
MERCIALYS 1.787% 23	2 300 000	2 386 849,70 €
MERCK & CO 1.875% 26	1 951 000	2 106 138,90 €
MERCK & CO 2.75% 25	520 000	430 084,43 €
MERCK FIN 4.5%10-20	900	981 597,20 €
MERCK NEW 2.80%2023	3 500 000	2 940 263,80 €
MERCK&CO 5%09-2019	3 857	3 377 387,03 €
MERLIN P 1750 260525	3 890 000	3 862 533,56 €
MERLIN PROP.2.225%23	1 316 000	1 380 867,83 €
MERLINENTT 2.75% 22	1 000 000	1 037 790,00 €
MET LIFE 0.875% 22	5 000 000	5 121 394,54 €
MET LIFE 2.375% 19	3 470 000	3 638 884,91 €
MET LIFE 2.375% 2023	6 006 000	6 595 739,64 €
METLIFE 3% 03/25	1 675 000	1 377 725,94 €
MEXIC SAB 4% 1027	3 000 000	2 362 328,53 €
MEXICO 3875 30/04/28	5 720 000	4 438 683,01 €
MFINANCE 1.398%2020	2 369 000	2 443 020,79 €
MGM RES 6625 151221	1 900 000	1 715 252,24 €
MI-ATL INT 4.1 0528	2 600 000	2 243 600,61 €
MICROSOFT 1.85% 0220	4 804 000	4 089 475,89 €
MICROSOFT 2 080823	3 015 000	2 453 254,16 €
MICROSOFT 2.70% 2025	1 345 000	1 118 226,01 €
MICROSOFT 2875 0224	7 530 000	6 385 292,85 €
MICROSOFT 3.125% 28	6 000 000	7 343 460,22 €
MICROSOFT1550 080821	13 850 000	11 438 519,40 €
MICROSOFT2400 080826	1 955 000	1 561 248,32 €
MITSUB FIN 2.95%2021	5 285 000	4 520 947,21 €
MIZUH 2953 0222	2 000 000	1 689 886,46 €
MIZUHO 2273 0921	4 625 000	3 832 961,68 €
MIZUHO FIN E50 23	2 300 000	2 294 546,70 €
MOLSON 1.25% 24	2 350 000	2 365 092,27 €
MOLSON C 2100 150721	5 525 000	4 579 756,76 €
MOLSON CO 1.45% 19	1 600 000	1 356 559,17 €
MOLSON COORS	2 760 000	2 179 467,43 €
MOLSON E3M 150319	2 648 000	2 649 071,12 €
MONDELEZ 3000 070520	4 350 000	3 732 742,49 €
MONDI FIN 1.50 24	4 222 000	4 324 714,40 €
MONDI FIN 1.62 26	1 680 000	1 689 091,28 €
MONDI FINAN 3.375%20	1 260 000	1 384 756,61 €
MONDIALE 5.05% 25	4 388 000	4 818 211,02 €
MOR STAN 1.342 1026	7 337 000	7 281 525,55 €
MORG 3737 0424	3 969 000	3 404 432,08 €
MORG 5.375% 08/20	40	2 317 064,62 €
MORG 5.625% 09/2019	1 850	1 657 045,74 €
MORG 5.75% 01/21	2 500	2 315 802,56 €
MORG Eurib3 11/21	300 000	298 541,83 €
MORGA STA 1.375 1026	2 740 000	2 715 458,20 €
MORGAN EURIB 122019	5 500 000	5 508 108,07 €
MORGAN 1% 12/2022	8 331 000	8 499 369,64 €
MORGAN 2750 190522	2 100 000	1 748 404,21 €
MORGAN 3300 0426	2 190 000	1 803 963,77 €
MORGAN 3625 0127	10 090 000	8 438 276,75 €
MORGAN C&C 2.97 23	8 710 000	7 355 470,85 €
MORGAN C&C 4.35 21	4 000	3 577 662,63 €
MORGAN ST 2.5 0421	6 650 000	5 581 716,84 €
MORGAN STA 3.875% 26	3 869 000	3 307 519,20 €
MORGAN STA 4.875% 22	3 260 000	2 916 495,41 €
MORGAN STAN 1.75% 24	16 185 000	16 868 509,59 €
MORGAN STAN 2.375%21	1 258 000	1 337 392,30 €
MORGAN STAN 2.8 0620	900 000	764 741,55 €
MORGAN STAN 3.70% 24	1 158 000	984 445,75 €
MORGAN STAN 3.772 29	1 370 000	1 146 473,03 €
MORGAN STAN 3.875%24	2 000 000	1 721 791,60 €
MORGAN STAN 7.3%19	2 750	2 465 399,29 €

MORGAN STAN.3.125%26	5 725 000	4 619 676,92 €
MORGAN STAN.3.75%23	2 025 000	1 757 144,88 €
MORGAN STAN.3.95%27	1 785 000	1 469 493,63 €
MORGAN STAN.4.35% 26	3 670 000	3 141 718,14 €
MORGAN STANL 4.1% 23	3 600 000	3 109 155,07 €
MORGAN STANLEY	12 455 000	10 873 351,13 €
MORGAN STANLEY 4% 25	395 000	342 699,09 €
MORGAN STL 3.125 23	4 805 000	4 065 695,01 €
MORGAN STLEY1.875%23	2 200 000	2 317 199,14 €
MOTIVA ENT 5.75 20	2 456 000	2 225 815,52 €
MOVIL SAB 5 03/20	742 000	659 863,43 €
MPLX 4000 0328	6 640 000	5 489 956,38 €
MPLX 4875 011224	5 677 000	5 039 760,74 €
MPLX LP 4% 2025	2 500 000	2 124 991,08 €
MPLX LP 4.5%23	325 000	289 559,12 €
MPLX LP 4125 010327	3 680 000	3 068 024,61 €
MPT 5000 1027	2 300 000	1 887 994,24 €
MPT OP 3325 240325	750 000	773 895,51 €
MPTOPERAT 4 08/22	850 000	958 187,42 €
MS 5.5%26/01/2020	11 000	9 973 591,90 €
MYLAN 1250 231120	1 151 000	1 185 377,08 €
MYLAN INC 4.20 1123	1 325 000	1 141 081,61 €
NA A B/NY 3.625 0623	6 350 000	5 430 086,36 €
NASDAQ OMX 3.875%21	2 000 000	2 211 447,95 €
NATION 1500 0326	9 315 000	9 235 858,52 €
NATION L3M 0329	800 000	670 328,47 €
NATIONAL RETAIL	4 413 000	3 575 038,37 €
NATIONWIDE 0625 0423	8 725 000	8 726 375,47 €
NATIONWIDE 3.90%2025	3 000 000	2 590 758,43 €
NATL 0875 1122	4 187 000	4 333 720,13 €
NATL 6875 0519	5 440 000	4 856 450,06 €
NATL AUSTR 2% 20	7 770 000	8 230 298,86 €
NATWEST 1125 0623	4 250 000	4 241 625,87 €
NAVIT 5000 1020	1 725 000	1 485 734,73 €
NBC UNIVER 4.37% 21	1 655	1 468 273,75 €
NESTL 0875 0725	16 317 000	16 627 710,57 €
NEUBERGE BE 4.5 0327	6 196 000	5 350 461,33 €
NEW Y LI GL 3 0128	1 900 000	1 555 779,77 €
NEW YORK L 2.9 0124	3 550 000	2 987 291,24 €
NEWELL RUBB 3.83 423	10 535 000	8 979 125,09 €
NEWELL RUBBE4.2 0426	810 000	678 180,89 €
NEWELL RUBBER TV21	3 450 000	2 951 152,84 €
NEWFIELD 5.75% 22	4 910 000	4 474 437,51 €
NEWS AMER 3%2022	9 338 000	7 888 292,60 €
NEXTERA 3550 010527	2 745 000	2 269 127,64 €
NGGLN 1.00 120724	5 100 000	5 182 056,07 €
NIBC BK 1125 190423	6 550 000	6 562 509,47 €
NISOURCE FI 3.85% 23	1 800 000	1 564 319,30 €
NN GP 1625 0627	3 912 000	3 974 857,85 €
NN GROUP 0875 130123	5 521 000	5 638 143,56 €
NN GROUP 1% 2022	8 296 000	8 510 135,59 €
NN GROUP 4625 130148	4 000 000	4 284 568,03 €
NOBLE ENERG 3.9% 24	2 625 000	2 224 668,11 €
NOBLE ERGY 3.85 0128	5 090 000	4 240 438,73 €
NOKIA 3.375 06/22	515 000	429 091,87 €
NOMURA EUR 1.125%20	2 618 000	2 671 676,22 €
NOR 3ERM 0222	4 000 000	4 028 670,22 €
NORD BK AB 0.30 0622	5 000 000	5 004 569,29 €
NORDEA AB 0.87 23	1 818 000	1 812 995,79 €
NORDEA B 1 0926	550 000	552 507,99 €
NORDEA BANK 4% 07/19	967 000	1 045 956,41 €
NORDEA BK 1.875%25	3 500 000	3 628 457,41 €
NORDEA BK 2.5%20	2 300 000	1 951 224,84 €
NORDSTROM 4% 03/27	5 475 000	4 560 397,63 €
NORTH GRUM 2008 1020	640 000	537 684,78 €
NORTH GRUM 3250 0128	2 719 000	2 240 551,53 €

NORTHERN TRST CO	1 850 000	1 492 115,59 €
NOS SGPS 1125 020523	2 500 000	2 519 927,40 €
NOVA 4875 0624	2 675 000	2 173 343,47 €
NOVA FIN 1.375 0830	4 022 000	4 052 660,51 €
NOVALIS OF 3% 2022	4 300 000	4 379 421,00 €
NOVARTI FIN 0.5 0823	3 000 000	3 035 405,43 €
NUCOR CORP	1 970 000	1 694 838,46 €
NUON FI 4500 1219	2 980 000	3 252 374,86 €
NUTRIEN 3150 180122	2 350 000	1 973 351,89 €
NUTRIEN LTD	1 700 000	1 381 265,47 €
NVENT FINANCE	1 350 000	1 158 467,84 €
NVIDIA CORP 3.20% 26	1 229 000	1 021 443,28 €
NWIDE 2000 0729	3 900 000	3 901 962,17 €
NYKREDIT 0.37 20 E	2 922 000	2 937 391,51 €
NYKREDIT 0.75% 21	2 350 000	2 395 902,72 €
NYKREDIT 2.75% 27	4 500 000	4 790 531,62 €
OAT 0% 25/10/2023	330 000	331 161,60 €
OAT 3% 25/04/22	754 433 924	855 917 608,96 €
OAT 3.50% 25/04/20	582 219 097	629 279 830,51 €
OAT 4.25%07-23	815 626 000	1 029 836 896,22 €
OAT ZCP 25/04/2021	9 831 119	9 959 906,66 €
OAT ZCP 25/04/2022	9 831 119	9 955 580,97 €
OAT ZCP 25/04/2023	9 879 118	9 954 298,09 €
OCCID PETROL 3% 27	670 000	548 435,36 €
OHIO NAT FI 6.375 20	2 365 000	2 151 655,24 €
OMEGA HE 4500 150125	4 800 000	4 104 595,09 €
OMNICOM 4.45% 2020	3 200	2 850 710,18 €
OMNICOM GP 3.6%26	6 800 000	5 590 554,58 €
OMNICOM GRP 3.65% 24	1 300 000	1 086 504,17 €
OMV 1000 1226	4 500 000	4 473 517,27 €
OMV 2875 0324	8 300 000	8 195 027,74 €
ONCOR 2.95%15-25	2 550 000	2 104 230,80 €
ONCOR ELEC 4.1% 06/2	1 500 000	1 317 251,23 €
ONCOR ELEC 7% 09/22	1 635 000	1 624 766,42 €
ONEOK INC 7.50% 2023	7 143 000	7 172 957,51 €
ONEOK PART 3.8% 20	4 000 000	3 483 499,64 €
OPTUS FINAN 3.5% 20	6 000 000	6 625 540,26 €
ORAC 2950 1124	12 785 000	10 563 224,58 €
ORAC 3250 1127	2 480 000	2 037 916,89 €
ORACL 2625 0223	3 200 000	2 699 238,58 €
ORACLE 3.125% 25	3 200 000	3 826 234,83 €
ORACLE 2.25 10/19	3 400 000	2 909 962,31 €
ORACLE 2.4% 23	2 550 000	2 085 712,39 €
ORACLE 3.875%2020	5 372 000	4 768 628,68 €
ORACLE CORP	1 925 000	1 540 505,61 €
ORACLE CORP 2.5% 22	3 000 000	2 496 963,73 €
ORAN 0.75 110923	4 100 000	4 167 348,01 €
ORANGE 1375 0328	6 700 000	6 666 346,44 €
ORANGE 0.875%16-2027	4 600 000	4 485 660,05 €
ORANGE 1% 052025	4 000 000	4 022 738,63 €
ORANGE 1.375 30	1 700 000	1 649 653,76 €
ORANGE 1625 031119	4 960 000	4 181 423,09 €
ORANGE 2.75% 2019	3 250 000	2 813 917,85 €
ORANGE 4% 49	3 500 000	3 867 717,30 €
ORANGE 5% 29/10/49	2 555 000	2 862 283,03 €
O'REI AUTO 4.35 0628	6 231 000	5 337 020,98 €
O'REILLY AUTO3.55%26	3 000 000	2 477 392,83 €
PAC GAS&E 3.30 1227	6 955 000	5 336 227,30 €
PACIFIC 3500 0625	1 030 000	821 432,83 €
PACIGA&ELE 2.95 0326	207 000	158 972,24 €
PACKAGG CORP 4.5% 23	2 430 000	2 166 613,85 €
PACKAGING CP 2.45 20	1 900 000	1 596 899,92 €
PARKER-H 1125 010325	2 900 000	2 927 608,63 €
PARTNERRE 1.25% 2026	7 680 000	7 322 147,73 €
PASO NATL 8.625% 22	875	887 403,11 €
PATTERSON-UTI	2 750 000	2 249 991,20 €

PEMEX 3.75% 03/19	710 000	732 415,67 €
PENSK 3950 0325	7 860 000	6 743 005,88 €
PENSKE TRUCK 4.25%23	1 000 000	887 094,53 €
PEOPLE'S UNT 3.65%22	4 935 000	4 214 911,83 €
PEPSICO 0.875% 2028	3 500 000	3 415 534,19 €
PEPSICO 3.60% 2024	2 600 000	2 275 832,30 €
PERNOD RI 2.125% 24	2 200 000	2 405 113,15 €
PERNOD RIC 1.875% 23	1 800 000	1 942 556,80 €
PETMX 6500 0327	4 125 000	3 685 246,52 €
PETROLEOS MEX 5.5 21	3 000 000	2 694 334,29 €
PETROLEOS MEXICA	6 425 000	5 305 277,31 €
PEUGE 2000 0325	3 800 000	3 722 949,02 €
PEUGEOT 2 24	4 500 000	4 549 540,68 €
PFIZER INC 0 03/20	589 000	590 470,26 €
PHILIPPS 66 4.3% 22	1 300 000	1 159 716,12 €
PHILIPS 0750 020524	800 000	801 239,18 €
PHILLIPS 3.605% 25	2 200 000	1 830 866,49 €
PIONEER NAT 3.45% 21	875 000	762 929,85 €
PIT BOWES 0470 0423	2 271 000	1 770 897,83 €
PKOBK 0750 0721	2 600 000	2 634 949,32 €
PLAIN 4500 1226	850 000	715 738,51 €
PLAINS ALL 2.6%19	2 925 000	2 482 047,45 €
PLAINS ALL 4.35%25	750 000	643 144,83 €
PNC BANK 1.80%2018	1 750 000	1 498 820,18 €
PNC BANK 3.10 1027	950 000	772 429,26 €
PNC BANK N 2.45%20	3 740 000	3 159 234,82 €
PNC BANK NA	4 000 000	3 312 166,50 €
PNC FUND 3.3% 03/22	2 000 000	1 722 413,03 €
PNC PITTSB 2.15% 25	6 100 000	5 085 391,25 €
POHJOLA BK 0875 0621	4 000 000	4 088 319,48 €
PPG INDS 0.875 1125	2 500 000	2 477 425,18 €
PPG INDS 0.875 22	3 900 000	3 980 144,73 €
PPG INDUS 0% 19	1 921 000	1 922 402,33 €
PRECISION 3250 0625	3 285 000	2 743 314,74 €
PRICEL GRP 2.375% 24	10 097 000	11 027 644,37 €
PRICELI GP 3.55 0328	1 195 000	982 119,99 €
PRICELIN 3600 010626	3 575 000	2 971 761,81 €
PRICOA GLOB 2.55% 20	5 700 000	4 824 129,38 €
PRINCIPFIN 3.10 26	1 825 000	1 464 178,69 €
PROCTER 4 7/8%27	2 570	3 448 865,90 €
PROGRECRP 5.375 0323	2 100 000	1 811 686,04 €
PROLINTL2 1.87 25	1 350 000	1 408 762,25 €
PROLOG LP 3.875 0928	1 600 000	1 370 993,01 €
PROLOGIS 1.375% 0521	5 700 000	5 889 658,57 €
PROLOGIS 1.375% 20	4 813 000	4 988 440,89 €
PROLOGIS 1750 0328	5 384 000	5 410 241,47 €
PROLOGIS 3% 01/22	6 631 000	7 291 506,19 €
PROLOGIS 3.375% 24	2 500 000	2 851 788,11 €
PROLOGIS 4.25%2023	5 000 000	4 472 749,21 €
PROSEGUR CASH	2 500 000	2 424 701,79 €
PROSEGUR SA 1 23	2 100 000	2 092 856,86 €
PROXIMUS 0.5 220322	4 000 000	4 053 843,04 €
PRUD 4.50% 2021	3 000	2 674 587,81 €
PRUDENT 7.575% 2019	1 000	894 691,88 €
PRUDENT FI 3.50 24	1 000 000	855 540,81 €
PRUDENT FI 4.5% 2020	9 240	8 187 595,22 €
PSA BAN F 0.75 0423	3 100 000	3 067 838,42 €
PSA BANQ 0625 1022	4 900 000	4 886 040,86 €
PSA BANQUE FR 0.5 20	2 500 000	2 522 644,43 €
PSE&G 3 15/05/25	2 000 000	1 657 128,17 €
PTN RE FIN 5.5 20	4 325 000	3 858 064,06 €
PUBLIC 2650 1122	1 850 000	1 525 528,39 €
PUBLICIS 1.125% 2021	1 200 000	1 239 733,51 €
PUBLICIS GRP 0.50%23	1 500 000	1 489 152,25 €
PUGET ENERGY INC	2 000 000	1 865 547,51 €
PUGET ENGY 6% 21	2 000 000	1 866 461,11 €



PVH CORP 3.625 24	3 000 000	3 328 210,03 €
PZU FIN 1.375% 19	4 911 000	4 968 082,52 €
QC INC 2900 0524	2 681 000	2 173 144,80 €
QUAL LIM3M 05/20	720 000	624 724,83 €
QUALC 3250 0527	16 125 000	12 910 661,30 €
QUALCOMM INC	1 425 000	1 203 768,31 €
QUINTILE IMS 3.25 25	300 000	294 300,00 €
QUINTILES 2875 0925	900 000	846 382,50 €
QVC 4.45% 15/02/2025	4 000 000	3 368 894,98 €
QVC 4.85% 14-2024	770 000	661 409,55 €
QVC INC 4.375% 2023	1 250 000	1 068 717,61 €
RABOBANK 2.50% 2026	9 500 000	9 916 257,13 €
RABOBANK 3.75% 2020	12 950	14 243 352,44 €
RABOBANK 3.875% 2023	1 500 000	1 755 877,18 €
RABOBANK 4,75%0622	6 192	7 303 890,63 €
RABOBANK 4.625% 23	2 375 000	2 053 236,60 €
RABOBANK 5.5% 20	9 150 000	9 776 785,01 €
RABOBANK 6.875 0320	4 500 000	5 073 235,89 €
RABOBANK N 2.5 0121	7 000 000	5 940 775,32 €
RABOBANK NL 1.25% 26	6 405 000	6 625 555,22 €
RABOBANK NL 3.875%22	2 300 000	2 025 070,93 €
RABOBK 5 7/8% 05/19	6 960	7 362 372,86 €
RAIFF 4500 0625	1 400 000	1 196 528,36 €
RAIFFEISEN 0.25 21	7 400 000	7 384 386,00 €
RAIFFEISEN BK 4.5%25	6 000 000	6 343 428,44 €
RAYMOND 5620 2424	8 167 000	7 589 108,95 €
RBS GRP PLC 5.375%19	7 300	8 072 643,21 €
RCI 1 17/05/23	2 000 000	2 011 548,34 €
RCI 1.625 04/25	2 800 000	2 840 696,34 €
RCI BANQUE	5 265 000	5 313 447,20 €
RCI BANQUE 0.5%2023	4 068 000	3 985 560,36 €
RCI BANQUE 0.625% 20	5 000 000	5 057 973,59 €
RCI BANQUE 0250 0721	4 000 000	3 983 721,09 €
RCI BANQUE E3M 0123	2 750 000	2 712 847,65 €
RCI BANQUE E3M 24	4 950 000	4 861 749,75 €
RCI BQE 0750 260922	7 786 000	7 845 953,95 €
RCI BQE 1375 080324	6 450 000	6 571 068,65 €
RCI BQUE 1.625 26	13 000 000	12 908 595,99 €
REALTY 3650 150128	4 575 000	3 825 153,36 €
REALTY IN. 3.875% 24	830 000	713 252,85 €
RECKITT 2750 0624	8 000 000	6 468 620,43 €
RED EL 2,125% 2023	5 500 000	5 918 420,41 €
RED ELECT 1250 0327	5 300 000	5 267 859,83 €
REDEXIS GAS 1.875 27	1 150 000	1 111 305,47 €
REGLP FIN 5% 2022	5 366 000	4 790 071,45 €
REGLP FIN 5.875% 22	1 140 000	1 050 199,89 €
RELFINANCE 0375 321	4 255 000	4 282 949,90 €
RELIANCE ST 4.5%23	2 090 000	1 845 171,68 €
RELX CAPI 1.30% 25	2 450 000	2 467 637,68 €
REN 1750 0128	3 730 000	3 705 937,41 €
RENAULT 1% 0424	6 400 000	6 338 140,10 €
RENFINANCE 4.75%2020	4 300 000	4 891 833,15 €
REP SVCS 3.375 1127	450 000	366 775,73 €
REPB SVC 3.95 0528	500 000	425 346,40 €
REPSOL 2.625% 2020	2 500 000	2 626 485,10 €
REPSOL INT 3.875% 21	3 200 000	3 353 108,61 €
RICHEMO INT 2 0338	2 750 000	2 777 575,78 €
RICHEMO INT 1.5 0330	2 676 000	2 710 249,03 €
RIO TINTO 3.75% 25	192 000	165 641,63 €
ROAD FIN 1.625 1224	3 824 000	3 781 766,80 €
ROAD FIN 2.375 1227	656 000	646 808,90 €
ROCK 4900 01/03/2022	2 125 000	1 928 026,05 €
ROCKIES 6.875% 0440	1 500 000	1 490 731,66 €
ROCK-T 4000 010323	1 335 000	1 171 234,31 €
ROCKWELL 1950 150719	370 000	316 101,15 €
ROCKWELL 3,2 150324	1 360 000	1 133 183,85 €

ROCKWELL COLLINS	1 145 000	942 566,79 €
ROGERS COMM 3.625%25	1 045 000	874 479,86 €
ROPER IND 3.125% 22	2 000 000	1 687 236,80 €
ROPER TE 2800 151221	515 000	431 037,64 €
ROPER TECH 3% 2020	3 000 000	2 552 575,91 €
ROYA BK CA 4.65 0126	3 270 000	2 890 108,09 €
ROYA BK SC 0625 0322	5 690 000	5 642 789,87 €
ROYAL BK 2000 080323	5 400 000	5 591 078,78 €
ROYAL BK 3.875% 2023	25 490 000	21 464 344,40 €
ROYAL BK 4800 050426	3 390 000	2 958 576,25 €
ROYAL BK SC 4.892 29	855 000	732 892,19 €
ROYAL CAR 2.65 1120	2 400 000	2 027 417,52 €
RTE RESEAU 1.875 37	2 700 000	2 746 271,45 €
RWE 5,75%33 EMTN	700	1 033 577,48 €
RWE FINANCE 1.875%20	5 000 000	5 180 777,80 €
RY SYS IN 2.875 0920	3 500 000	2 996 930,07 €
RYANAIR 1.875% 21	2 613 000	2 731 104,25 €
RYDER SYSTEM 2.5 010	450 000	370 561,43 €
SABINE P 5625 010221	4 200 000	3 845 524,38 €
SABINE PL 5 03/27	1 005 000	888 192,58 €
SABINE PL 5.75 24	13 970 000	12 854 920,67 €
SALESFORCE 3250 0423	7 470 000	6 398 926,43 €
SALESFORCE.COM	2 060 000	1 761 551,47 €
SALINI IMPREGILO	400 000	348 946,52 €
SAMMONS FIN 4.45 27	7 000 000	5 955 555,80 €
SAMPO 1250 0525	14 756 000	14 724 715,57 €
SAMPO OYJ 1 0923	23 950 000	24 438 060,55 €
SAMPO PLC 1.62 28	300 000	299 834,04 €
SAMV 1800 0724	1 054 000	981 021,04 €
SANCO 0750 0323	600 000	602 891,91 €
SANEF 0.95% 1028	3 900 000	3 719 114,26 €
SANOFI 1% 0326	7 700 000	7 822 869,02 €
SANOFI 0.50 0323	9 200 000	9 306 697,53 €
SANOFI 1.375 0330	700 000	703 569,17 €
SANOFI 1.75% 14-2026	200 000	215 951,02 €
SANPAOLO 5.35% 18	14 600 000	15 336 186,01 €
SANT HDGS 3.70 22	6 830 000	5 812 674,20 €
SANTAN 3125 190127	2 500 000	2 587 545,78 €
SANTAN C 0875 240122	3 200 000	3 234 551,09 €
SANTAN CONS 0.90% 20	200 000	203 318,21 €
SANTAN CONS 1 0521	4 000 000	4 082 810,38 €
SANTAN UK 2.87 21	6 220 000	5 225 745,31 €
SANTAND 156 110422	5 800 000	5 091 886,05 €
SANTAND IS 3.25% 26	3 900 000	4 067 891,49 €
SANTAND ISSU 2.5% 25	2 000 000	2 002 617,93 €
SANTAND UK 5 23	5 965 000	5 235 782,66 €
SANTANDER 0.25%2019	900 000	904 461,76 €
SANTANDER 2125 1120	2 050 000	1 709 498,03 €
SANTANDER 2500 0121	2 500 000	2 114 794,04 €
SANTANDER 4.50% 2025	2 825 000	2 421 604,86 €
SANTANDER INTL	10 200 000	10 642 940,28 €
SANTANDEU 1.125 0923	5 700 000	5 749 984,05 €
SANTC BK 0.75 1022	1 800 000	1 810 978,41 €
SANTD 3.5 0422	3 200 000	2 691 728,07 €
SANUK 3823 1128	2 170 000	1 717 918,99 €
SAP SE 1% 13/03/2026	300 000	306 275,13 €
SAP SE E3M 0321	4 500 000	4 520 205,00 €
SAPRR Eurib3 19	3 600 000	3 615 290,40 €
SBAB BK AB 0.75 0623	2 900 000	2 923 192,20 €
SCA HYGIE 1.625 327	1 482 000	1 511 644,23 €
SCA HYGIEN 1.125 324	5 550 000	5 654 369,69 €
SCANIA e3m 24/10/18	835 000	835 628,57 €
SCENTRE MG 1.5% 20	6 967 000	7 247 025,70 €
SCENTRE MGM 1375 323	2 306 000	2 401 293,69 €
SCHAEFF 3500 150522	8 500 000	8 592 366,67 €
SCHAEFFLFI 3.25% 25	6 888 000	7 346 040,52 €

SCHAEFFLFI 4.75 23	3 430 000	2 980 192,27 €
SCHLMB NOR 4.20 21	2 303 000	2 049 769,61 €
SCHNEID 0875 1226	2 000 000	1 964 519,93 €
SCHNEIDER E1.375 27	1 000 000	1 009 059,06 €
SCOR 3%15-2046	8 100 000	8 220 915,95 €
SCOR SE 3.625 0548	4 100 000	4 307 836,21 €
SEB 0500 0323	450 000	451 943,75 €
SELECT INCOM 4.15%22	4 825 000	4 174 705,55 €
SELP FI SA 1.50 1125	2 300 000	2 282 314,09 €
SEMPRA 9.8% 15/02/19	815	752 362,28 €
SERVICE COR 5.375%24	2 750 000	2 423 327,34 €
SES GLOBAL GP 2.5%19	3 000 000	2 573 891,20 €
SES SA 3.6% 23	6 700 000	5 648 360,24 €
SG 2.5% 2026	2 900 000	3 052 904,28 €
SG 0.75%15-2020	500 000	511 198,57 €
SG 0750 26/05/23	6 400 000	6 463 401,74 €
SG 2.625% 27/02/25	1 800 000	1 865 633,84 €
SG 4.25% 2022	3 800 000	4 551 227,38 €
SG Eurib3 03/23	2 300 000	2 253 808,53 €
SGOB 1125 0326	8 500 000	8 330 560,45 €
SGSP AUSTR 2 22	5 000 000	5 311 904,92 €
SHELL INTF 1.75 21	3 625 000	2 994 869,50 €
SHELL INTL 0.75%2028	3 000 000	2 877 631,31 €
SHELL INTL 1.625% 27	2 170 000	2 294 454,43 €
SHELL INTL FIN	1 435 000	1 218 492,42 €
SHELL INTL2.125% 20	3 275 000	2 774 779,39 €
SHERW 3125 0624	3 000 000	2 461 019,51 €
SHERW WILL 2.75 22	6 765 000	5 624 266,73 €
SHIRE ACQ 1.90% 2019	3 475 000	2 946 161,22 €
SHIRE ACQ 2.875%2023	1 390 000	1 128 650,84 €
SHIRE ACQ IN 2.4 921	5 645 000	4 664 802,44 €
SIEMENS FIN.2.35% 26	1 950 000	1 511 968,87 €
SIGMA 4875 0328	2 675 000	2 215 652,86 €
SIMON INTL 1.375% 22	1 808 000	1 887 538,39 €
SIMON PROP 2.50% 21	8 000 000	6 765 528,96 €
SISIM 1625 0228	2 900 000	2 774 828,98 €
SKANDINAV 2.5% 2026	5 000 000	5 237 295,27 €
SKANDINAV 2.625%2021	2 490 000	2 110 757,78 €
SKANDINAV ENSKIL	3 750 000	3 170 434,35 €
SKY PL 2.875% 11/20	3 500 000	2 940 808,80 €
SKY PLC 2.50 09/26	4 002 000	4 391 210,13 €
SL GREEN O 3.25 1022	17 541 000	14 690 415,36 €
SLB 0,625% 19	4 760 000	4 793 340,87 €
SMBC 2.25 07/19	6 600 000	5 667 560,28 €
SMITHFI FO 2.65 1021	1 500 000	1 234 861,46 €
SMURFIT 2.875% 0126	4 100 000	4 081 014,15 €
SMURFIT 2375 0224	1 982 000	2 024 648,24 €
SMURFIT AC 4.12 20	1 050 000	1 129 118,81 €
SNAM 0.875% 16-2026	1 400 000	1 306 736,93 €
SNAM 0000 251020	4 512 000	4 488 690,11 €
SNAM 1.25 0125	4 000 000	3 981 698,02 €
SNAM 1375 1027	2 400 000	2 307 549,31 €
SNS BANK TV051125	7 500 000	8 136 599,51 €
SNTDER UK 3.571% 23	5 070 000	4 295 183,62 €
SOC GEN 4% 23	1 800 000	2 000 462,97 €
SOCIETE 1125 0125	10 200 000	10 024 563,36 €
SOCIETE G 1% 04/22	6 000 000	6 054 483,87 €
SOCIETE GE 0.5 0123	4 700 000	4 600 960,11 €
SODEXO 0750 14042027	3 800 000	3 630 002,20 €
SODEXO SA 1.125 0525	300 000	302 494,36 €
SODEXO SA 2.5 0626	625 000	689 612,15 €
SOFTBANK 4.75 25	500 000	521 578,75 €
SOFTBANK 5125 0927	2 325 000	1 873 233,63 €
SOGE 1375 0228	21 500 000	20 804 669,79 €
SOGECAP 4.125% 99	1 200 000	1 244 507,94 €
SOLVAY 5118 0621	2 200 000	2 394 472,95 €

SOLVAY FI 4.199% 49	7 000 000	7 204 484,96 €
SOUTHERN P 1.95 1219	2 700 000	2 275 684,55 €
SP GLOBAL 3.30%2020	7 540 000	6 538 057,10 €
SPAREB VT 0.50 1122	2 000 000	1 999 457,81 €
SPAREBANK 075 030723	4 300 000	4 294 625,00 €
SPCM 2.875 06/23	1 000 000	1 005 737,50 €
SPECTRA PA 3.50 25	1 400 000	1 152 003,77 €
SPECTRA PARTNERS	2 750 000	2 191 267,51 €
SPI ELECT 2.375% 20	4 100 000	4 390 885,00 €
SPIRT AERO 3.85 26	2 930 000	2 415 333,35 €
SPRINT SPECT 3.36%21	5 000 000	3 444 585,71 €
SPRISPEC 4.738 0325	4 000 000	3 407 823,03 €
ST FONCIERE 1.875%21	5 900 000	6 249 002,70 €
STAND CHART 4.05% 26	2 925 000	2 447 356,05 €
STANDARD 0750 1023	5 200 000	5 153 466,18 €
STANDARD 1625 1027	2 450 000	2 430 413,25 €
STANDARD CH 2.1 0819	3 875 000	3 303 604,41 €
STAR 5000 1221	2 050 000	1 770 298,92 €
STARBUCKS C 2.45 26	1 625 000	1 247 675,16 €
STATE ST LIBOR 0647	10 000 000	7 597 107,75 €
STATE STREET 1.95%21	3 350 000	2 784 163,56 €
STATE STREET 3.55%25	1 500 000	1 300 405,76 €
STATOIL 2.875% 25	4 000 000	4 671 866,68 €
STATSTREET 2.55%2020	2 400 000	2 054 481,61 €
STDER CS BK 0.375 20	700 000	704 293,07 €
STE AUTO 1.875% 25	2 600 000	2 796 716,54 €
STE AUTO 2.25% 20	2 000 000	2 091 103,93 €
STE FONCIERE 2.25%22	3 900 000	4 206 737,49 €
STGOBAIN 4.50 19	1 330	1 449 852,41 €
STO EN OYJ 2.5 0328	972 000	983 006,24 €
STRYKER CO 3.37 24	2 000 000	1 683 114,21 €
STRYKER CP 3375 1125	3 000 000	2 488 704,98 €
SUEDZ 1000 1125	3 000 000	2 922 158,42 €
SUEDZUCKER 1.25 23	200 000	205 275,45 €
SUEZ 2875 1299	600 000	597 942,14 €
SUEZ 5.50% 07/2024	2 100 000	2 786 617,65 €
SUEZ CO 1 030425	3 300 000	3 330 939,32 €
SUEZ ENVIRON 3% 2020	2 700 000	2 784 768,71 €
SUMIT MIT 10.74 1022	7 530 000	6 493 994,27 €
SUMIT MITSU 2.058%21	6 670 000	5 538 297,53 €
SUMITOMO 2.25%20	4 789 000	5 102 904,21 €
SUMITOMO MI 0.934 24	4 000 000	4 020 772,78 €
SUMITOMO MITSUI	2 500 000	2 143 018,14 €
SUMITOMO MITSUI	8 680 000	7 287 943,75 €
SUMITOMO MITSUI	100 000	100 500,77 €
SUMITOMO MITSUI 1%22	3 390 000	3 476 666,87 €
SUNOCO LOG 4.25% 24	2 675 000	2 283 930,86 €
SUNOCO LS 4 011027	1 010 000	815 536,59 €
SUNTRUST 4000 010525	8 162 000	7 062 322,94 €
SVB FINANC. 5.375%20	3 500	3 172 902,66 €
SVENS 3350 0521	1 160 000	997 228,58 €
SVENSKA 0375 0723	2 100 000	2 087 967,00 €
SVENSKA 1250 020328	4 322 000	4 298 462,94 €
SVENSKA 2.656% 24	2 600 000	2 664 915,87 €
SVENSKA HAND 2.4% 20	13 130 000	11 102 649,88 €
SVENSKA HND 1.875%21	5 250 000	4 319 886,73 €
SVENSKA HNDL 1.95 20	2 659 000	2 228 930,39 €
SVENSKA HNDL 2.45%21	6 300 000	5 302 344,86 €
SVENSKA HNDLSBKN	17 297 000	17 969 841,29 €
SWEDBANK 0250 1122	4 265 000	4 254 365,38 €
SWEDBANK AB 2.8 0322	4 725 000	3 993 992,98 €
SWEDBANK VRN 24	4 200 000	4 293 549,54 €
SWISS BV 2.6% 25	7 600 000	7 715 123,49 €
SWISSCOM AG 1.125 26	8 845 000	8 879 160,25 €
SYDNEY 1750 0428	4 153 000	4 200 188,35 €
SYDNEY AIR 2.75% 22	9 300 000	10 297 037,33 €

SYF 3650 0521	3 275 000	2 816 559,38 €
SYNCHRON 3.70 26	1 825 000	1 458 661,81 €
SYNCHRON 3.95 27	3 275 000	2 594 842,10 €
SYNCHRON 4.25 24	4 585 000	3 908 497,66 €
SYNCHRONY FI 2.75%20	410 000	351 450,64 €
SYNGEN NV 4.89 25	3 750 000	3 175 548,16 €
TALANX 8.3673% 42	2 000 000	2 464 853,08 €
TALANX AG 3.125% 23	6 000 000	6 835 897,81 €
TALANX E3M 1247	9 300 000	8 480 516,61 €
TALLGRASS NRG	2 242 000	1 978 885,92 €
TCP 3900 0527	855 000	692 067,53 €
TD AMERITR 3.3 0427	1 550 000	1 275 530,10 €
TD AMERITR 3.62 25	2 750 000	2 344 416,25 €
TDC 1.75% 27	2 170 000	2 157 609,30 €
TDF 2.5% 07/04/26	3 400 000	3 519 498,11 €
TDF INFRA TF 22	1 000 000	1 093 421,65 €
TEL.ITA.7,75%33	492	692 481,44 €
TELE 1875 0725	1 300 000	1 288 899,78 €
TELECOM 7.721%08-38	1 480	1 370 338,53 €
TELEF EM 1.447 0127	7 300 000	7 096 570,90 €
TELEF SAU 5.462 21	1 625 000	1 486 273,32 €
TELEFO 2625 0623	4 900 000	4 588 114,33 €
TELEFON E 1.528 125	6 000 000	6 125 400,14 €
TELEFON.5 7/8%33	2 000	2 848 607,18 €
TELEFONIC 0.318% 20	5 000 000	5 036 678,97 €
TELEFONIC 1715 0128	2 200 000	2 154 839,60 €
TELEFONICA 2.242% 22	3 300 000	3 525 417,10 €
TELEFONICA 3.75% 22	2 600 000	2 637 235,56 €
TELEFONICA 4.71%20	8 300 000	9 084 279,78 €
TELEFONICA 8.25%30	1 500	1 690 064,67 €
TELEFONICA EMIS	7 241 000	6 078 128,50 €
TELEFONICA EUROP	4 400 000	4 153 317,31 €
TELEFONICA TVPERP.	2 000 000	1 861 309,86 €
TELEKFIMA 3.125% 21	15 353 000	17 124 674,56 €
TELEKOM FIN 1.5%26	17 200 000	17 589 520,58 €
TELFON DEUT 2.375%21	6 473 000	6 860 799,99 €
TELFONICA D 1.75 25	5 900 000	5 920 473,00 €
TELIA CO 3000 040478	1 500 000	1 533 922,29 €
TELIASONER 3.875% 25	3 000	3 673 127,42 €
TELIASONERA 3% 0927	1 735 000	2 030 557,32 €
TELSTRA 1.125 0426	2 267 000	2 239 958,89 €
TENN 1375 0628	9 600 000	9 712 798,03 €
TENNET H 2995 010624	7 300 000	7 324 690,22 €
TENNET HL 0.75 06/25	1 500 000	1 492 148,00 €
TEOLL VOI 2% 0524	3 360 000	3 369 201,34 €
TEOLL VOIM 2.625%23	3 205 000	3 393 960,21 €
TERNA 4.875%10/19	667	731 264,07 €
TERNA SPA	12 850 000	12 524 129,93 €
TES L LP 6.25% 10/22	196 000	176 213,10 €
TES LOG L 6.375 0524	2 810 000	2 581 597,50 €
TESORO 5.125% 2024	1 250 000	1 118 353,84 €
TESORO C 5375 011022	7 123 000	6 322 733,11 €
TEVA FNC 1,25% 03/23	2 750 000	2 502 030,24 €
TEVA PH 2200 011021	1 635 000	1 311 388,89 €
TEVA PHA 6.75 0328	3 075 000	2 730 792,52 €
TEVA PHARM 0.375% 20	2 222 000	2 172 458,23 €
TEVA PHARM 1.125% 24	4 912 000	4 193 101,88 €
TEVA PHARMA 1.70%19	1 590 000	1 338 830,86 €
TEVA PHARMA 2.80% 23	575 000	431 785,58 €
THALES 0750 0125	600 000	591 612,97 €
THALES SA	6 800 000	6 808 022,26 €
THERMO 1450 0327	3 250 000	3 228 301,17 €
THERMO FISH 2.95%26	2 850 000	2 276 075,40 €
THERMO FISH3.3%02/22	2 350 000	2 025 824,59 €
THERMO FISHE 0.75%24	5 289 000	5 237 353,42 €
THERMO FISHER 3% 23	370 000	309 826,47 €

THYSS 1.375 030322	3 350 000	3 373 402,73 €
THYSSENKR 3.125% 19	1 000 000	1 050 149,73 €
TIME WAR 3.6% 25	3 695 000	3 058 822,62 €
TIME WARNR 3.80 27	2 135 000	1 751 898,97 €
TLG IM 1375 1124	2 600 000	2 618 648,06 €
TMCC 2 24/10/18	6 575 000	5 642 788,45 €
T-MOBILE 6500 150126	2 200 000	2 002 306,82 €
T-MOBILE USA 6.5% 15	2 200 000	- €
TORO 1850 0920	8 050 000	6 747 407,58 €
TORONTO 0375 120121	3 400 000	3 447 086,34 €
TORONTO BK 2.5% 20	4 000 000	3 373 934,97 €
TORONTO DM 1.80 21	5 125 000	4 239 587,17 €
TORONTO L3M 0621	2 710 000	2 325 087,04 €
TOT SYS 4% 0623	2 028 000	1 749 994,00 €
TOTAL CAP 0625 1024	3 200 000	3 212 373,87 €
TOTAL CAP 1375 1029	7 200 000	7 375 698,54 €
TOTAL CAP 2.875% 25	500 000	582 532,54 €
TOTAL CAP 5.125% 24	3 000 000	3 797 508,86 €
TOTAL CAPI 0.75%28	7 000 000	6 782 218,58 €
TOTAL S.A. 2.708% 49	5 700 000	5 847 857,52 €
TOTAL S.A. 3.369%26	1 500 000	1 580 432,36 €
TOTAL SA 2.25% 49	30 060 000	30 920 884,34 €
TOTAL SA 2.625% 49	7 042 000	7 093 502,81 €
TOTAL SA 3.875% 22	5 138 000	5 554 543,63 €
TOTAL SYST 3.75% 23	645 000	548 673,08 €
TOTAL SYSTE 3.8 0421	5 965 000	5 185 476,15 €
TOY FIN AUS 0.5 0423	1 750 000	1 744 942,29 €
TOYOTA MTR 1.80%2020	1 600 000	1 689 015,04 €
TR INFR 2.2 05/08/25	4 300 000	4 704 054,06 €
TRANS ALLEGHENY 3.85	2 275 000	1 951 744,09 €
TRANS-CANADA 3.8% 20	1 000	874 987,03 €
TRANSCANADA 5.875%76	368 000	318 704,56 €
TRANSURBA 3.375 0327	3 675 000	2 941 412,50 €
TRANSURBAN 1.75 28	2 410 000	2 429 673,42 €
TRIMBLE 4900 0628	2 625 000	2 247 061,15 €
TRINITY A 2.12512 22	3 874 000	4 059 171,89 €
TRINITY ACQ 3.5% 21	1 735 000	1 490 520,36 €
TWARN CABL 4% 21	6 000 000	5 202 461,00 €
TWARN CABL 4.125%21	1 500 000	1 309 900,00 €
TWARN CABL 8.25 19	1 000 000	905 968,34 €
TYCO ELEC 3.125 0827	775 000	626 544,35 €
TYCO ELECTR 1.1% 23	8 131 000	8 411 954,40 €
TYSON 3550 0627	5 625 000	4 564 736,25 €
TYSON FOODS 2.65% 19	7 835 000	6 746 255,66 €
UBS 0250 0122	10 223 000	10 190 033,69 €
UBS 1250 0425	9 692 000	9 667 222,27 €
UBS AG 4.75% 2026	11 203 000	12 242 461,02 €
UBS AG LD 1.125% 20	2 600 000	2 659 936,41 €
UBS AG LDN 0.625 230	9 719 000	9 759 932,08 €
UBS AG LOND 1.25% 21	3 610 000	3 763 656,44 €
UBS AG STA 2.35% 20	6 800 000	5 786 257,74 €
UBS GRO F 3.491 0523	1 875 000	1 576 809,70 €
UBS GROUP 1.75% 22	1 430 000	1 505 535,39 €
UBS GROUP FUNDIN	1 000 000	1 059 935,02 €
UBS GROUP FUNDIN	4 500 000	4 437 523,38 €
UBS GROUP FUNDIN	10 110 000	8 771 920,65 €
UBS LDN 0125 051121	7 740 000	7 707 916,32 €
UDR 4.625% 01/2022	2 000 000	1 798 802,10 €
UDR INC 3.50 0727	4 887 000	3 954 447,32 €
UNI DI BAN 0.75 1022	1 050 000	991 290,21 €
UNIB 1125 0925	10 200 000	10 273 597,83 €
UNIB 2250 0538	15 900 000	15 986 914,94 €
UNIBAIL 1875 150131	4 200 000	4 238 018,92 €
UNIBAIL 2125 250723	7 900 000	7 751 096,77 €
UNIBAIL 2875 250426	1 500 000	1 458 971,30 €

UNIBAIL-RODAM 2.5%24	3 300 000	3 667 299,01 €
UNIC 1000 0123	11 566 000	11 043 581,65 €
UNICREDIT 2.125% 26	2 700 000	2 702 633,13 €
UNICREDIT 4.375% 27	3 020 000	3 156 066,72 €
UNICREDIT 5.75%2025	3 580 000	3 909 891,61 €
UNICREDITO 3.25% 21	11 105 000	11 863 007,15 €
UNILEVER N 0.375 223	5 100 000	5 129 203,53 €
UNILEVER NV	3 650 000	3 697 090,07 €
UNILEVER NV 0875 725	4 400 000	4 490 025,61 €
UNILEVER NV 1 0227	3 991 000	3 984 131,17 €
UNION PA 3500 080623	975 000	836 644,08 €
UNION PAC 3.95 28	12 369 000	10 625 793,15 €
UNION PAC 4% 21	3 000 000	2 659 823,28 €
UNIONE DI BA 4.25%26	3 043 000	3 029 610,39 €
UNIPL 3500 1127	722 000	707 020,18 €
UNIQA INS.6.875% 43	2 000 000	2 450 592,05 €
UNIQA INSURANCE 6%46	1 000 000	1 209 823,70 €
UNIT TECH 1.125% 21	1 780 000	1 836 524,58 €
UNITE 3850 0628	5 673 000	4 859 656,48 €
UNITED 2150 180530	770 000	786 726,70 €
UNITED 2500 0423	4 000 000	3 327 613,86 €
UNITED 2800 0524	2 005 000	1 631 869,40 €
UNITED PARCEL	6 090 000	6 120 659,78 €
UNITEDHEALTH 3.10%26	1 125 000	926 950,67 €
UNITEDHEALTH 3.75%25	6 575 000	5 716 203,80 €
UNITYMEDHN 4 25	2 600 000	2 768 133,33 €
URENCO FIN. 2.25% 22	5 000 000	5 452 769,27 €
US AIR 3.95%13-2025	10 000 000	6 366 770,57 €
US BANCORP	1 545 000	1 331 571,97 €
US BANCORP 1.95% 18	3 300 000	2 827 307,61 €
US BANCORP 2.95 22	3 200 000	2 712 789,46 €
US BANCORP 3.10% 26	1 050 000	852 908,23 €
US BK OHIO 3150 0421	5 815 000	5 011 755,04 €
USA 2750 0228	7 905 000	6 775 462,53 €
USA 2750 300423	6 000 000	5 165 568,74 €
USBK 0850 0624	5 000 000	4 998 256,90 €
UTD HEALTH 2.875% 23	1 500 000	1 261 211,51 €
VALE ENE PA 4.5 0328	3 800 000	3 234 109,03 €
VALEO SA	1 600 000	1 593 545,84 €
VALEO SA 0625 110123	1 800 000	1 793 519,69 €
VALEO SA 1625 0326	1 400 000	1 415 802,22 €
VALEOSA1,5%180625	3 500 000	3 521 827,53 €
VALERO 6.125%10-2020	2 100	1 923 483,65 €
VALERO ENE 3.65% 25	1 080 000	912 951,74 €
VALIDUS HLDGS	905 000	1 134 836,80 €
VENTAS REAL.4.125%26	1 197 000	1 029 621,97 €
VEOLIA ENV 0 1120	2 000 000	1 999 352,80 €
VEOLIA ENVR 0.314 23	3 500 000	3 455 976,81 €
VEOLIA ENVRNMT	4 300 000	4 467 889,01 €
VERCOM INC 3125 0322	1 000 000	852 056,18 €
VERI COM 1.875 1029	7 436 000	7 423 618,29 €
VERISK ANAL 4% 25	6 375 000	5 392 391,12 €
VERIZON 3.376% 0225	5 926 000	4 921 649,88 €
VERIZON 4.125 27	6 689 000	5 716 317,34 €
VERIZON 4329 0928	7 250 000	6 143 160,25 €
VERIZON COM 0.875%25	4 500 000	4 431 702,06 €
VERIZON COM 1.375 26	3 593 000	3 588 968,43 €
VERIZON COM 1.75% 21	4 930 000	4 053 271,71 €
VERIZON COM 2.875 38	4 003 000	3 980 348,00 €
VERIZON COMM 3% 2021	8 700 000	7 370 627,39 €
VERIZON COMM 5.15%23	11 700 000	10 831 982,36 €
VERIZON COMM INC	2 000 000	1 672 524,14 €
VERIZON COMM INC	1 500 000	1 153 842,45 €
VERIZON LIBUS3M 0525	3 605 000	3 100 030,22 €
VESTEDA FI 1.75 19	2 279 000	2 346 410,63 €

VIACOM INC 3.875% 24	800 000	668 375,85 €
VIER GAS TRANS 2%20	1 620 000	1 681 914,27 €
VIMPELCOM 4950 0624	3 350 000	2 707 078,61 €
VIRGIN 5.25% 01/2021	1 515	1 351 231,30 €
VISA INC 2.2% 20	6 500 000	5 473 690,39 €
VISA INC 2.80 122022	1 000 000	841 546,64 €
VISA INC 3.15% 12/25	1 500 000	1 245 007,71 €
VIVAT NV 2.375 05/24	2 490 000	2 588 987,51 €
VIVENDI 0.75%16-2021	2 100 000	2 130 690,08 €
VIVENDI 1.125%16-23	1 900 000	1 947 415,34 €
VMWARE I 2.95 210822	3 710 000	3 079 713,61 €
VODA 3750 0124	745 000	634 034,85 €
VODAF GP 4375 0525	8 296 000	7 097 172,75 €
VODAF GP 4375 0528	13 275 000	11 260 247,34 €
VODAF GP 1.125 1125	6 341 000	6 298 033,58 €
VODAFONE 0.50% 24	2 950 000	2 895 376,88 €
VODAFONE 0375 221121	150 000	150 828,12 €
VODAFONE 2.50% 2022	2 552 000	2 102 399,73 €
VODAFONE 2.95% 2023	4 175 000	3 486 648,17 €
VOLK 0625 0921	5 600 000	5 609 593,26 €
VOLK BK 1.25 1225	4 258 000	4 143 207,37 €
VOLKS 1250 0624	9 100 000	9 009 693,09 €
VOLKS 1375 0125	6 779 000	6 741 135,78 €
VOLKS 3375 0624	2 700 000	2 655 057,95 €
VOLKS BK 0.75 0623	5 733 000	5 642 261,30 €
VOLKS BK E3M 0621	1 300 000	1 291 562,35 €
VOLKS IF 3.30% 2033	2 900 000	3 199 316,04 €
VOLKS LEAS 2.625% 24	200 000	216 848,18 €
VOLKSW 4625 0628	10 200 000	10 135 334,80 €
VOLKSW E3M70 1221	1 900 000	1 902 324,07 €
VOLKSW F 1.875 0327	15 900 000	15 729 531,92 €
VOLKSWA 1.125 1023	3 600 000	3 628 323,38 €
VOLKSWAGEN 0.375 21	350 000	349 869,44 €
VOLKSWAGEN 0.75%20	1 900 000	1 935 198,32 €
VOLKSWAGEN 0.875 23	7 229 000	7 171 111,28 €
VOLKSWAGEN 2.125% 22	3 300 000	3 488 744,25 €
VOLKSWAGEN 3.875% 18	6 500 000	6 742 330,69 €
VOLKSWAGEN 4.625% 26	1 500 000	1 564 610,77 €
VOLKSWAGEN PERP	2 400 000	2 301 545,33 €
VOLKSWAGEN PERPET	3 600 000	3 562 770,93 €
VOLVO 4200 10/06/75	4 200 000	4 421 746,03 €
VOLVO CAR 3.25% 21	1 550 000	1 648 087,88 €
VONOVIA BV	5 300 000	5 266 769,00 €
VONOVIA BV 075 0124	2 300 000	2 262 547,27 €
VONOVIA BV 1.5 0326	6 600 000	6 588 457,76 €
VONOVIA FI 1.12 25	3 000 000	2 951 065,30 €
VONOVIA FI 1.50 26	3 000 000	2 968 479,92 €
VONOVIA FIN 2.25% 23	3 500 000	3 761 231,13 €
VOYA FIN 3.125 0724	2 000 000	1 637 348,87 €
VOYA FIN 3650 0626	2 869 000	2 322 832,14 €
WAL MART 3.40 23	2 955 000	2 542 853,15 €
WALBOOTS3.3%11/2021	1 600 000	1 367 218,53 €
WALG BOOT 3.8%11/24	1 260 000	1 065 239,86 €
WALM INC 2.85 0620	5 000 000	4 290 158,88 €
WAL-MART 3.30% 2024	1 500 000	1 285 497,41 €
WALMT 3550 0625	10 695 000	9 198 695,41 €
WALMT 3700 0628	7 433 000	6 401 188,87 €
WASTE MAN 2.4 0523	2 545 000	2 078 963,43 €
WATSON PHA 3.25%2022	2 471 000	2 072 557,59 €
WELLS 2625 0722	2 275 000	1 895 913,71 €
WELLS 1500 0527	300 000	298 358,95 €
WELLS 2400 0120	1 000 000	856 619,99 €
WELLS FAR 1.625% 25	4 289 000	4 414 070,83 €
WELLS FAR 1375 1026	1 700 000	1 703 741,71 €
WELLS FAR 3.5% 03/22	13 035 000	11 247 696,75 €
WELLS FAR 5.875% 25	2 305 000	2 034 507,25 €



WELLS FARG 3000 0426	4 500 000	3 591 276,60 €
WELLS FARGO 1.125%21	5 373 000	5 553 532,34 €
WELLS FARGO 1.5%22	10 887 000	11 407 888,43 €
WELLS FARGO 2.15%20	4 700 000	3 999 025,52 €
WELLS FARGO 2.25% 23	3 494 000	3 751 213,32 €
WELLS FARGO 3% 2026	11 970 000	9 500 782,75 €
WELLS FARGO 4.10% 26	2 425 000	2 034 766,54 €
WELLS FARGO 4.6%2021	4 000	3 572 491,30 €
WELLS FARGO 7.98% 18	3 289 000	2 856 519,43 €
WELLTOWER 4 0625	7 000 000	5 895 549,56 €
WELLTOWER INC	3 249 000	2 754 974,49 €
WENDEL SA 1% 0423	2 700 000	2 707 633,97 €
WESFARMERS 2.75% 22	6 250 000	7 023 729,54 €
WEST 1650 0519	9 165 000	7 789 105,25 €
WEST 4750 0226	3 075 000	2 599 276,97 €
WESTERN GA 5.375% 21	1 610 000	1 431 808,25 €
WESTERN GAS 4%2022	800 000	678 769,89 €
WESTERN GAS PART	1 060 000	886 716,71 €
WESTLA CH 3.6 150826	4 130 000	3 393 494,24 €
WESTP BKGN 1.60 19	5 000 000	4 243 696,44 €
WESTPA LIBUS3M 0520	995 000	854 640,29 €
WESTPAC 0375 050323	6 000 000	5 947 183,06 €
WESTPAC BANK 2.85%26	3 375 000	2 689 935,65 €
WESTPAC BANKING	10 000 000	9 874 028,93 €
WESTPAC BKG 0.5 25	4 370 000	4 364 350,33 €
WESTROCK 3% 09/24	2 748 000	2 250 133,15 €
WHI POFIN 1.10 1127	6 000 000	5 767 333,37 €
WILL PART 5.25% 2020	1 141	1 021 481,09 €
WILLIAMS COS 4.55%24	2 275 000	1 941 875,35 €
WILLIAMS PAR 3.9%25	1 800 000	1 526 781,72 €
WILLIAMS PARTNE.4%25	5 225 000	4 414 723,35 €
WILLIS N 3600 150524	245 000	203 841,76 €
WILLOW NO.2 3.375%22	5 430 000	6 079 550,15 €
WLLS FRG CO 3.069 23	6 650 000	5 607 773,19 €
WOLTERS 1500 0327	2 547 000	2 605 117,90 €
WOODSIDE FIN.3.70%26	2 800 000	2 326 718,34 €
WORLDPAY FIN 3.75%22	3 000 000	3 237 840,00 €
WPP 1375 0325	11 314 000	11 336 907,23 €
WPP FINAN 0.75% 19	3 670 000	3 722 922,44 €
WPP FINANC 3.625%22	3 100 000	2 620 511,09 €
WPP FINANCE 1.625%30	8 200 000	7 765 937,89 €
WURTH FIN 1 25	1 600 000	1 629 608,31 €
WYNDHAM WORLDWID	3 475 000	2 941 005,58 €
XEROX 2.75% 19	2 840 000	2 444 144,06 €
XEROX 3625 150323	75 000	62 278,81 €
XLIT 3250 0647	1 600 000	1 551 498,02 €
XLIT LTD 4.45 25	1 075 000	916 768,46 €
YOR BLD S 0.875 0323	1 150 000	1 146 937,69 €
YORKSHRE BLD 1.25%22	3 550 000	3 632 598,67 €
ZAPA 1750 0328	1 096 000	1 098 046,52 €
ZF NA CAP 2.75% 23	6 700 000	7 159 273,91 €
ZIMMER BIO 2.425%26	2 650 000	2 786 316,13 €
ZIMMER BIOM 1.414%22	2 000 000	2 061 754,25 €
ZOETIS 3.25%13-2023	6 000 000	5 110 764,70 €
ZUERCH KBK 2.625%27	5 500 000	5 676 959,87 €
ZURICH 7.50%09-2039	175	9 988 430,66 €

### TITRE DE CREANCE NEGOCIABLE

**Encours sous gestion dans la poche**

**557 708 380 €**

Libellé des valeurs	Quantité de titres	Valeur des titres au 30/06/2018
CR07 -0.3% 07/02/18	3 300 000	3 301 249,98 €
CR07 -0.3% 11/04/18	4 000 000	4 004 096,72 €
CR16 0.00% 08/02/18	50 000 000	42 737 296,91 €
CR16 -0.2% 08/01/18	1 300 000	1 302 460,06 €

CR16 -0.3% 02/02/18	24 000 000	24 007 897,76 €
CR16 -0.3% 03/11/17	6 000 000	6 007 446,73 €
CR16 -0.3% 09/02/18	16 500 000	16 536 432,36 €
CR16 -0.3% 10/04/18	8 500 000	8 500 026,81 €
CR16 -0.3% 14/05/18	4 500 000	4 502 017,38 €
CR16 -0.3% 16/04/18	15 000 000	15 000 035,24 €
CR16 -0.3% 18/04/18	22 900 000	22 918 232,73 €
CR16 -0.3% 20/02/18	3 000 000	3 001 523,51 €
CR16 -0.3% 21/03/18	17 500 000	17 500 030,29 €
CR16 -0.4% 15/05/18	10 000 000	10 000 023,38 €
CR16 27/10/17	2 000 000	2 002 343,73 €
CR31 0.00% 11/01/18	50 500 000	43 228 512,68 €
CR31 0.00% 17/05/18	25 350 000	21 544 070,54 €
CR31 0.00% 20/07/17	50 400 000	43 123 118,57 €
CR31 0.00% 22/03/18	25 925 000	22 108 633,10 €
CR31 0.00% 24/05/18	25 000 000	21 235 892,48 €
CR31 0.00% 25/01/18	28 015 000	23 964 332,25 €
CR31 0.00% 26/04/18	25 375 000	21 594 792,66 €
CR31 0.00% 29/03/18	25 325 000	21 588 141,43 €
CR36 -0.2% 09/03/18	20 000 000	20 046 566,79 €
CR36 -0.2% 23/03/18	25 000 000	25 062 775,29 €
CR36 -0.2% 23/03/18	25 000 000	25 065 501,03 €
CR36 -0.2% 27/03/18	25 000 000	25 065 501,03 €
CR36 -0.3% 14/03/18	20 000 000	20 014 666,93 €
CR36 -0.3% 14/09/17	3 700 000	3 702 798,49 €
CR36 -0.3% 23/03/18	9 000 000	9 015 645,85 €
CR36 -0.3% 27/03/18	20 000 000	19 999 819,19 €
CR36 -0.3% 28/03/18	10 000 000	10 026 497,81 €

## ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIFS

**Encours sous gestion dans la poche**

**8 510 095 024 €**

Libellé des fonds	Quantité de titres	Valeur des titres au 30/06/2018
ABERDEN GL EMERG MKT	18 609 336,77	152 993 278,02 €
ACADIAN GLBL EQTY	1 080 000,00	21 297 600,00 €
AMUNDI 3M I2	60 146,48	599 726 155,84 €
AMUNDI CASH INSTITUT	54 140,69	539 729 212,53 €
AVIVA I EMERG. MARKT	75 257,92	94 966 448,30 €
AXA WORLD FUNDS	1 266 437,53	252 723 464,16 €
BLACKROCK GLOBAL FD	12 253 585,30	254 087 019,92 €
BNP PARIBAS AQUA I	265,00	10 462 369,60 €
BNP PARIBAS INVEST3M	270,91	271 906 397,60 €
BNPP MOIS	169,92	3 917 815,13 €
BNY MELLON GL-EMM	82 016 643,84	108 770 135,17 €
BRSF SIC	1 269 742,25	123 804 083,54 €
COMGEST EMERG 3DEC	7 498 824,00	249 265 007,44 €
DIMENSIONAL EMERG	12 292 702,08	263 678 459,59 €
FIDELITY FDS EMERG	24 907 495,98	310 823 704,71 €
FIDELITY FUNDS HIGH	17 056 382,34	190 351 301,35 €
FIRST STATE WORLDW	3 340 000,00	6 448 872,00 €
FISHER EMERG MRKTS	1 751 021,23	227 422 637,09 €
FRANK TEMP INV EMKT	18 803 140,54	421 784 292,53 €
GAM MULTIBD	1 651 177,54	449 567 751,44 €
GROUPAMA CASH 4DEC	6 061,56	244 387 583,99 €
HSBC GIF GL	2 439 467,52	81 101 769,64 €
JANUS HANDE GL C FU	7 900 000,00	17 079 800,00 €
JANUS HEND GL C FUND	576 033,56	67 103 186,19 €
JUPITER ECOLOGY CL.I	2 430 000,00	11 639 874,48 €
KBI INST WATER H	775 000,00	15 523 250,00 €
MULTI UNITS FRA LYXO	275 000,00	9 540 437,50 €
MULTIPART ROBECO	526 000,00	14 717 480,00 €
NEUBER BERGMAN	15 883 868,54	312 358 033,27 €
PARVEST ENVIRT OPPO	104 000,00	20 407 920,00 €
PICTET CLEAN ENERG	220 500,00	18 643 275,00 €
PICTET FUND LUX	1 279 147,61	203 997 502,77 €

PICTET FUNDS LUX -EM  
PICTET WATER CL.I

243 515,28  
29 900,00

88 118 514,15 €  
9 875 372,00 €

PIMCO EMERGING	18 479 870,00	195 791 179,74 €
QUONIAM-EM MKT EQUIT	219 608,41	267 294 174,06 €
SCHRODER INTL FUND	904 860,08	138 309 167,18 €
SCHRODER SICAV	1 045 000,00	18 907 080,50 €
SCHRODERS INTL EMERG	22 818 132,62	423 429 241,59 €
SPARINVEST ETHICAL	79 500,00	14 612 100,00 €
STONE HARBOR-EM MKLC	2 955 487,13	313 559 325,97 €
TOBAM A/B EM MK EQ-A	18 870,94	181 565 447,49 €
UNION + SI.3DEC	6 709,00	1 280 389 302,68 €
VONTOBEL NEW POWER I	76 000,00	8 018 000,00 €

### FONDS D'ACTIFS NON-COTES

<b>Engagement global de la poche</b>	<b>1 336 149 944 €</b>
--------------------------------------	------------------------

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

### FONDS DE DETTES - FONDS COLLECTIFS

<b>Engagement global de la poche</b>	<b>1 131 000 000 €</b>
--------------------------------------	------------------------

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

**FONDS DE DETTES - FONDS DEDIES**

<b>Engagement global de la poche</b>	<b>650 000 000 €</b>
--------------------------------------	----------------------

**Libellé des fonds**

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

**FONDS DE CAPITAL INVESTISSEMENT - FONDS DEDIES**

<b>Engagement global de la poche</b>	<b>400 000 000 €</b>
--------------------------------------	----------------------

**Libellé des fonds**

FPS ARD FF FRR A FPS LGT FOF FRR CI SWEN FDS DE FDS A	
---	--