



**COMPOSITION DU PORTEFEUILLE DU FRR  
AU 31 DECEMBRE 2018**

**ACTIONS**

**Encours sous gestion dans la poche**

**8 724 505 863 €**

<b>Libellé des valeurs</b>	<b>Quantité de titres</b>	<b>Valeur des titres au 31/12/2018</b>	<b>Ratio d'emprise</b>
2CRSI	19 200	161 280,00 €	0,1082%
4IMPRINT GROUP	408 620	8 399 575,51 €	1,4549%
A2 CORPORATION	52 175	341 243,11 €	0,0071%
AAC TECHNO HOLD NV	130 023	660 273,33 €	0,0107%
AAREAL BANK	9 218	248 793,82 €	0,0154%
AARHUSKARLSHAMN AB	480 000	5 811 149,48 €	0,1892%
ABC-MART	31 600	1 531 868,34 €	0,0383%
ABIOMED	5 629	1 600 533,75 €	0,0125%
ABN AMRO GROUP	893 089	18 344 048,06 €	0,0950%
ACADEMEDIA AB	490 835	1 903 287,17 €	0,4665%
ACCESSO TECHNOLOGY	154 900	2 502 423,26 €	0,5683%
ACCIONA	281 779	20 823 468,10 €	0,4921%
ACCOR	156 959	5 824 748,49 €	0,0555%
ACCSYS TECHNOLOGIE	1 218 531	1 462 237,20 €	1,0334%
ACERINOX	431 203	3 735 080,39 €	0,1562%
ACKERMANS HAAREN	80 445	10 602 651,00 €	0,2402%
ACS ACT.CONSTR.	430 462	14 562 529,46 €	0,1368%
ACTIVISION	88 988	3 625 220,80 €	0,0117%
ADECCO NOM.	8 027	327 163,11 €	0,0048%
ADIDAS NOM.	53 936	9 837 926,40 €	0,0269%
ADIENT PLC	27 500	362 288,41 €	0,0294%
ADMIRAL GROUP	9 851	224 667,12 €	0,0034%
ADOBE SYSTEMS	6 512	1 288 785,27 €	0,0013%
ADP (PROMESSE)	174 317	28 849 463,50 €	0,1761%
ADVAN	101 400	742 183,71 €	0,1884%
ADVANCE AUTO PARTS	57 300	7 892 628,26 €	0,0786%
ADVANCED MICRO ORD	69 567	1 123 393,10 €	0,0070%
AEGON	6 658 216	27 158 863,06 €	0,3177%
AENA	92 608	12 571 536,00 €	0,0617%
AERCAP HOLDINGS NV	7 550	261 540,48 €	0,0051%
AGEAS	306 412	12 041 991,60 €	0,1509%
AHLSSELL AB	945 600	4 860 953,13 €	0,2167%
AIA GROUP LTD	605 037	4 394 049,82 €	0,0050%
AIB GROUP PLC	2 266 397	8 340 340,96 €	0,0835%
AIR FRANCE	138 637	1 314 278,76 €	0,0323%
AIR LIQUIDE	126 751	13 746 145,95 €	0,0295%
AIR LIQUIDE 2020	127 281	13 803 624,45 €	0,0296%
AIR N.ZEALAND	267 203	485 880,63 €	0,0238%
AIRBUS SE	357 815	30 042 147,40 €	0,0461%
AISIN SEIKI	147 600	4 495 525,86 €	0,0501%
AJ BELL PLC	513 670	1 377 245,68 €	0,1262%
AKKA TECHNOLOGIES	66 017	2 917 951,40 €	0,3253%
AKZO NOBEL	162 855	11 464 992,00 €	0,0715%
ALD INTERNATIONAL	277 221	2 883 098,40 €	0,0686%
ALEXION PHARMA. INC	24 644	2 098 884,52 €	0,0110%
ALFA LAVAL	64 730	1 211 252,54 €	0,0154%

ALIBABA SPON.ADR	52 459	6 290 123,89 €	0,0020%
ALLIANZ	316 025	55 348 618,50 €	0,0745%
ALLSTATE	146 441	10 585 154,90 €	0,0425%
ALPES (COMPAGNIE)	101 391	2 504 357,70 €	0,4153%
ALPHA FINANCIAL	1 332 227	3 324 815,87 €	1,3176%
ALPHABET CL. A	21 298	19 468 624,49 €	0,0071%
ALPHABET CL. C	27 064	24 517 997,67 €	0,0077%
ALS LTD	339 248	1 416 493,06 €	0,0697%
ALSTOM REGROUPT	1 337 683	47 180 079,41 €	0,5987%
ALTAREA	3 054	506 353,20 €	0,0190%
ALTEN	217 284	15 796 546,80 €	0,6423%
ALTICE CL.A	932 808	1 584 840,79 €	0,0584%
ALTICE CL.B	11 072	18 822,40 €	0,0053%
ALTRAN TECHN.	1 697 202	11 888 900,02 €	0,6603%
ALUMINA	806 630	1 142 535,41 €	0,0280%
AMADEUS IT HOLDING	67 122	4 083 702,48 €	0,0153%
AMAZON COM	33 765	44 363 396,80 €	0,0069%
AMBEA AB	389 004	3 335 416,64 €	0,5753%
AMERICAN EXPRESS	187 554	15 638 933,89 €	0,0221%
AMERICAN INTL GRP	326 587	11 259 059,33 €	0,0369%
AMERICAN WATER WKS	93 400	7 416 277,83 €	0,0517%
AMERISUR RESOURCES	4 331 479	741 256,94 €	0,3564%
AMP	1 070 241	1 614 786,58 €	0,0364%
AMPHENOL CL.A	11 411	808 747,08 €	0,0038%
AMUNDI	95 802	4 422 220,32 €	0,0475%
ANDRITZ AG	135 384	5 431 606,08 €	0,1302%
ANGLE PLC	1 730 277	751 833,36 €	1,2059%
ANGLO IRISH BANK	1 655 585	- €	0,0000%
ANHEUSER BUSCH S	238 676	13 771 605,20 €	0,0118%
ANSELL	99 973	1 356 943,54 €	0,0754%
ANTHEM INC	38 093	8 751 576,42 €	0,0147%
ANTOFAGASTA	110 296	962 440,28 €	0,0112%
AOI ELECTRONICS	76 600	1 538 465,34 €	0,6383%
AOI TYO HOLDINGS	100 000	630 677,39 €	0,4071%
AON PLC	9 107	1 158 022,59 €	0,0038%
AP MOELLER MAERS.A	191	197 080,05 €	0,0018%
AP MOELLER MAERS.B	313	343 264,21 €	0,0031%
APA GROUP ST.SECU.	1 089 492	5 703 092,75 €	0,0923%
APERGY CORP	23 874	565 549,51 €	0,0309%
APPLE	189 647	26 168 847,28 €	0,0040%
APPLEGREEN	548 967	3 348 698,70 €	0,4551%
APPLIED MATERIALS	63 639	1 822 631,20 €	0,0067%
APPLUS SERVICES	771 428	7 475 137,32 €	0,5394%
APTIV PLC	77 868	4 193 966,46 €	0,0296%
ARATA CORP	28 000	973 364,05 €	0,1553%
ARCHER DANIELS	396 600	14 213 971,92 €	0,0707%
ARIAKE JAPAN	20 700	1 178 417,92 €	0,0631%
ARISTOCRAT LEISURE	27 184	365 622,96 €	0,0043%
ARIX BIOSCIENCE PLC	1 051 073	1 949 792,82 €	0,7789%
ARKEMA	164 431	12 325 747,76 €	0,2147%
AROUNDTOWN SA	1 814 523	13 100 856,06 €	0,1608%
ARUHI CORP	55 000	873 978,54 €	0,1524%
ASAHI GLASS	35 000	957 178,52 €	0,0154%
ASAHI GROUP HOLDIN L	325 200	11 068 976,65 €	0,0672%
ASAHI INTEC	65 400	2 419 504,91 €	0,0503%
ASAHI KASEI	296 800	2 674 072,14 €	0,0212%
ASCENDAS REAL EST	951 445	1 569 305,68 €	0,0306%
ASCENTIAL PLC	1 461 891	6 140 414,54 €	0,3647%
ASHTREAD GROUP	445 258	8 120 855,06 €	0,0936%
ASM PACIFIC TECHN.	170 361	1 436 147,71 €	0,0419%
ASML HOLDING	39 677	5 442 097,32 €	0,0093%
ASML HOLDING	10 900	1 483 845,51 €	0,0026%
ASOS PLC	51 231	1 299 682,32 €	0,0611%
ASR NEDERLAND	21 097	729 534,26 €	0,0150%

ASSA ABLOY AB	48 004	749 070,80 €	0,0045%
ASSICURAZ.GEN.ORD.	1 063 036	15 520 325,60 €	0,0679%
ASSYSTEM	69 952	1 892 201,60 €	0,4465%
ASTRAZENECA	62 392	4 082 538,20 €	0,0049%
ASX	30 467	1 124 640,95 €	0,0157%
AT AND T	424 012	10 585 927,03 €	0,0058%
ATEME	24 765	271 424,40 €	0,2377%
AT-GROUP	49 100	937 600,41 €	0,1396%
ATLANTIA	276 461	4 995 650,27 €	0,0335%
ATLAS ARTERIA LTD	267 359	1 030 710,27 €	0,0391%
ATLAS COPCO A SHS	32 544	675 926,20 €	0,0039%
ATLAS COPCO B	18 458	352 077,02 €	0,0047%
ATLASSIAN CORPORAT	22 163	1 725 113,71 €	0,0200%
ATOS ORIGIN	344 218	24 604 702,64 €	0,3220%
AUBAY	20 000	563 000,00 €	0,1516%
AUCKLAND INTL ARPT	296 895	1 250 414,18 €	0,0246%
AURELIUS	78 820	2 500 170,40 €	0,2562%
AURIZON HLDGS LTD	1 131 972	2 983 643,40 €	0,0569%
AURUBIS AG	84 289	3 642 970,58 €	0,1875%
AUS.NZL BKG GROUP	336 296	5 065 771,75 €	0,0117%
AUSNET SERVICES	5 080 868	4 865 592,89 €	0,1391%
AVACTA	1 010 331	343 324,56 €	0,8722%
AVANZA HOLDING BK	227 107	9 492 109,05 €	0,7502%
AVEVA GROUP PLC	118 425	3 193 008,75 €	0,0734%
AVIVA	398 821	1 668 511,90 €	0,0102%
AXA	3 907 277	73 683 429,67 €	0,1611%
AXEL SPRINGER	125 170	6 180 894,60 €	0,1160%
AXWAY SOFTWARE	30 000	372 600,00 €	0,1413%
B&S GROUP SA	250 245	3 303 234,00 €	0,2973%
BAKKAFROST	115 000	4 916 580,38 €	0,2354%
BAKKAVOR GROUP PLC	1 576 065	2 475 908,47 €	0,2720%
BALOISE HOLDING	3 571	429 065,05 €	0,0073%
BANCA GENERALI	249 226	4 518 467,38 €	0,2133%
BANCA POP.EMILIA	504 562	1 697 346,57 €	0,1048%
BANCO BILBAO VIZC.	4 399 047	20 391 782,36 €	0,0660%
BANCO BPM S.P.A	2 681 103	5 276 410,71 €	0,1769%
BANCO SABADELL	5 806 310	5 809 213,16 €	0,1032%
BANDO CHEM.IND.	89 900	746 892,66 €	0,1904%
BANK AMERICA	1 873 291	40 377 807,14 €	0,0194%
BANK IRELAND	1 351 365	6 567 633,90 €	0,1253%
BANK OF EAST ASIA	318 639	886 478,00 €	0,0112%
BANK QUEENSLAND	91 093	544 156,98 €	0,0227%
BANKIA S.A	755 995	1 935 347,20 €	0,0245%
BANKINTER	1 122 168	7 875 375,03 €	0,1248%
BARCLAYS	1 390 515	2 331 907,06 €	0,0081%
BARRATT DEV.	255 168	1 315 712,22 €	0,0252%
BARRY CALLEBAUT N.	62	84 232,85 €	0,0011%
BASF SE	316 170	19 096 668,00 €	0,0344%
BASIC-FIT	217 451	5 642 853,45 €	0,3978%
BASTIDE LE CONFORT	14 383	373 958,00 €	0,1959%
BASWARE	60 822	2 402 469,00 €	0,4223%
BAYER	388 815	23 546 636,40 €	0,0417%
BAYER.MOTO.PRIV.	312 994	19 436 927,40 €	0,5629%
BB AND T	424 400	16 082 760,79 €	0,0556%
BBA AVIATION	1 503 099	3 654 127,37 €	0,1456%
BCA MARKETPLACE	1 429 030	3 502 719,63 €	0,1822%
BCA MEDIOLANUM	467 264	2 378 373,76 €	0,0631%
BCO ESPIRITO SANTO	3 323 765	- €	0,0591%
BCO SANT.CENT.HISP	11 348 890	45 089 139,98 €	0,0699%
BCP BCO COMERCIAL	1 218 383	279 618,90 €	0,0081%
BECTON DICKINSON	53 160	10 478 074,80 €	0,0197%
BEIERSDORF NOM.	154 050	14 043 198,00 €	0,0611%
BELC	53 200	2 197 213,06 €	0,2549%
BELIMO HOLDING	2 887	10 093 868,14 €	0,4694%

BEND.AND ADEL.BANK	89 851	597 051,54 €	0,0184%
BENETEAU	76 000	872 480,00 €	0,0918%
BERKELEY UNIT	30 871	1 196 593,05 €	0,0239%
BERKSHIRE HATHAWAY B	62 335	11 133 762,24 €	0,0046%
BGP HOLDINGS	3 056 274	- €	0,0000%
BHP GROUP LTD	212 996	4 489 994,51 €	0,0072%
BIC	213 558	19 038 695,70 €	0,4641%
BIG YELLOW	1 233 036	11 999 965,98 €	0,7398%
BILFINGER BERGER	12 961	330 246,28 €	0,0293%
BIOMERIEUX	404 710	23 270 825,00 €	0,3419%
BIOTAGE AB	650 000	6 990 626,54 €	0,9969%
BLUESCOPE STEEL	100 733	679 907,43 €	0,0189%
BMW	299 453	21 171 327,10 €	0,0497%
BNP PARIBAS	1 166 470	46 046 403,25 €	0,0933%
BOC AVIATION LTD	307 500	1 990 986,18 €	0,0443%
BOC HKG HOLD.	578 920	1 882 267,00 €	0,0055%
BOEING	129 519	36 539 279,62 €	0,0228%
BOIRON	66 788	3 269 272,60 €	0,3802%
BOLIDEN NV18	13 505	255 815,48 €	0,0049%
BOLLORE INVEST.	4 027 453	14 096 085,50 €	0,1376%
BONDUELLE	91 541	2 599 764,40 €	0,2836%
BOOKING HOLDINGS INC	5 293	7 975 129,31 €	0,0114%
BOOZT AB	516 673	2 306 803,48 €	0,9051%
BORAL (NEW)	434 838	1 322 884,42 €	0,0371%
BORR DRILLING LTD	607 465	1 313 271,98 €	0,1140%
BOSHIWA INTL	122 000	- €	0,0059%
BOSTON SCIENTIFIC	167 981	5 193 061,75 €	0,0121%
BOUYGUES	1 267 206	39 714 236,04 €	0,3403%
BP	994 452	5 494 941,44 €	0,0049%
BP PLC SPONSORED	245 763	8 152 327,31 €	0,0073%
BPOST - PROMESSES	294 852	2 360 290,27 €	0,1474%
BRAMBLES	786 451	4 915 924,16 €	0,0494%
BREMBO SPA	575 000	5 114 625,00 €	0,1722%
BRENNTAG	211 420	7 970 534,00 €	0,1368%
BRIDGESTONE	130 600	4 410 927,38 €	0,0171%
BRIGHTOIL PETRO HLD	508 000	- €	0,0050%
BRITISH LAND	196 284	1 166 047,90 €	0,0205%
BROTHER INDUSTRIES	427 600	5 560 610,01 €	0,1631%
BT GROUP	347 057	920 664,83 €	0,0035%
BUNZL	59 590	1 572 822,80 €	0,0177%
BURBERRY GROUP	74 273	1 436 140,52 €	0,0181%
BURCKHARDT COMPRES	3 859	788 990,68 €	0,1135%
BUREAU VERITAS	1 491 139	26 534 818,52 €	0,3372%
BUZZI UNICEM ORD.	308 165	4 630 179,13 €	0,1864%
BYGGHEMMA GROUP	609 700	1 936 782,59 €	0,5679%
C. UYEMURA & CO	91 400	4 481 796,07 €	0,9253%
CAFE DE CORAL HOLD	684 137	1 450 804,76 €	0,1168%
CAIRN ENERGY	658 401	1 100 330,34 €	0,1117%
CAIRN HOMES LTD	2 690 762	2 879 115,34 €	0,3411%
CALTEX AUSTRALIA	238 132	3 736 669,15 €	0,0913%
CANCOM SE	142 650	4 088 349,00 €	0,4071%
CAP GEMINI	434 220	37 690 296,00 €	0,2596%
CAPITACOMM.REIT	1 828 935	2 054 125,89 €	0,0488%
CAPITALAND	503 700	1 005 363,41 €	0,0121%
CAPITAMALL TRST FD	2 858 066	4 145 447,59 €	0,0775%
CARDINAL HEALTH	180 125	7 027 577,31 €	0,0605%
CARGOTEC B	104 932	2 803 783,04 €	0,1902%
CARL ZEISS MEDITEC	60 000	4 098 000,00 €	0,0671%
CARLSBERG PREF.S.B	10 730	995 865,70 €	0,0090%
CARNIVAL	8 987	376 782,14 €	0,0054%
CARREFOUR	2 405 575	35 867 123,25 €	0,3048%
CASINO GUICHARD	517 380	18 801 589,20 €	0,4715%
CATHAY PAC.AIRWAYS	1 702 000	2 118 431,53 €	0,0433%
CATTOLICA ASSICUR.	60 455	429 532,78 €	0,0347%

CECONOMY AG	838 034	2 636 454,96 €	0,2349%
CELLECTIS	38 000	573 040,00 €	0,0896%
CELLNEX TELECOM	254 710	5 702 956,90 €	0,1099%
CEMEX ADR OPC A-B	196 506	828 551,74 €	0,0130%
CENTENE	22 585	2 277 960,46 €	0,0110%
CENTRAL JAP.RAILW.	32 200	5 947 287,81 €	0,0156%
CENTRICA	953 073	1 432 449,98 €	0,0167%
CENTURY LEAS. SYS.	92 200	3 550 657,91 €	0,0865%
CERV INFO SOL	614 753	4 398 557,72 €	0,3148%
CFG LTD	223 873	- €	0,0061%
CGG	910 336	1 052 348,42 €	0,1282%
CHALLENGER FCIAL	90 447	528 600,83 €	0,0148%
CHAMPION REIT	1 604 318	960 782,16 €	0,0274%
CHARGEURS	220 000	3 696 000,00 €	0,9341%
CHEUNG KONG PROPER	371 634	2 379 248,19 €	0,0101%
CHEVRON CORP	384 072	36 550 927,59 €	0,0201%
CHINA EVERBRIGHT	1 537 000	1 205 537,34 €	0,0250%
CHINA HIGH PRECIS.	152 000	- €	0,0147%
CHINA MENGNIU	896 437	2 443 876,67 €	0,0228%
CHINA METAL RECYCLIN	89 400	- €	0,0000%
CHINA MILK PROD TP	239 000	- €	0,0000%
CHINA TRAVEL INTL	2 962 000	691 673,32 €	0,0543%
CHNA ANIM HLTH CRE	167 770	- €	0,0085%
CHOCOL.LINDT SPRUN	5	325 228,50 €	0,0037%
CHOCOLAD.LINDT BP	189	1 023 072,14 €	0,0176%
CHOW TAI FOOK JEWL	1 724 220	1 257 985,24 €	0,0172%
CHR. HANSEN HOLD.	162 700	12 571 316,40 €	0,1234%
CHRISTIAN DIOR	12 468	4 163 065,20 €	0,0069%
CHUBB LTD	33 922	3 833 306,18 €	0,0074%
CIGNA	151 827	25 224 147,17 €	0,0399%
CIMAREX ENERGY	19 962	1 076 549,27 €	0,0209%
CIMIC GROUP LTD	68 079	1 819 995,93 €	0,0210%
CINEWORLD GROUP	2 500 000	7 331 067,91 €	0,1823%
CISCO SYSTEMS	622 973	23 613 191,69 €	0,0139%
CIT GROUP	249 100	8 339 287,93 €	0,2469%
CITIGROUP	124 520	5 670 744,17 €	0,0051%
CITY DEVELOPMENTS	224 198	1 168 364,89 €	0,0247%
CK HUTCHISON	374 748	3 148 667,85 €	0,0097%
CLARIANT NOM.	67 017	1 075 816,43 €	0,0202%
CLARKSON	160 000	3 386 997,94 €	0,5276%
CLEAN HARBORS	29 700	1 282 154,57 €	0,0530%
CLOETTA	482 996	1 158 046,65 €	0,1707%
CNA HONGXING SPRT	449 000	- €	0,0160%
CNH INDUSTRIAL NV	889 027	6 977 083,90 €	0,0657%
CNP ASSURANCES	1 621 173	30 024 123,96 €	0,2361%
COATS GROUP PLC	4 489 648	4 076 723,44 €	0,3145%
COCA COLA EUR	368 546	14 783 200,28 €	0,0758%
COCA-COLA	134 200	5 558 649,35 €	0,0032%
COCA-COLA AMATIL	526 288	2 654 451,73 €	0,0727%
COCA-COLA HBC	51 663	1 411 371,80 €	0,0141%
COCHLEAR	9 320	996 226,38 €	0,0161%
COFACE	143 817	1 140 468,81 €	0,0934%
COGELEC	166 707	1 078 594,29 €	1,8735%
COLES GROUP LTD	135 612	980 468,58 €	0,0102%
COLRUYT	319 166	19 864 891,84 €	0,2223%
COMCAST CL.A	808 063	24 069 059,31 €	0,0178%
COMFORTDELGRO	2 159 108	2 979 226,78 €	0,0997%
COMMERZBANK NV	1 423 633	8 232 869,64 €	0,1137%
COMPASS GROUP PLC	74 730	1 373 789,76 €	0,0047%
COMPUGROUP MEDICAL	184 253	7 451 191,32 €	0,3462%
COMPUTERSHARE	145 244	1 537 593,52 €	0,0268%
COMSYS HOLDINGS	150 000	3 208 800,46 €	0,1064%
COMW.BK AUSTRALIA	121 143	5 400 629,25 €	0,0068%
CONAGRA FOODS	506 100	9 456 585,75 €	0,1042%

CONOCOPHILLIPS	435 599	23 758 559,82 €	0,0378%
CONSORT MEDICAL	300 000	3 125 174,09 €	0,6077%
CONSTELLATION CL.A	9 969	1 402 453,38 €	0,0060%
CONTACT ENERGY	1 055 997	3 654 611,86 €	0,1473%
CONTINENTAL	61 551	7 432 283,25 €	0,0308%
CONVATEC GROUP	2 528 700	3 914 688,49 €	0,1286%
COSMOS PHARMA.	21 700	3 174 874,64 €	0,1085%
COSTAR GROUP	6 943	2 048 857,65 €	0,0191%
COSTCO WHOLESALE	12 792	2 279 541,90 €	0,0029%
COVESTRO AG	128 251	5 531 465,63 €	0,0701%
CRANEWARE	92 555	2 526 430,28 €	0,3467%
CRANSWICK	100 000	2 932 427,16 €	0,1939%
CREATE SD HOLDINGS	50 700	1 065 979,54 €	0,0759%
CREDIT AGRICOLE	2 296 822	21 659 031,46 €	0,0801%
CREDIT SUISSE GRP	110 978	1 063 592,51 €	0,0043%
CREO MEDICAL GROUP	1 028 099	2 279 446,28 €	0,8532%
CREST NICHOLSON HG	390 174	1 426 718,37 €	0,1519%
CRH	39 247	906 605,70 €	0,0048%
CRH PLC	50 452	1 162 935,92 €	0,0062%
CRITERIA CAIXACORP	1 985 062	6 280 736,17 €	0,0332%
CRODA INTERNATIO PLC	27 515	1 436 218,32 €	0,0209%
CROWN	157 791	1 152 482,61 €	0,0233%
CSL	18 245	2 080 455,84 €	0,0040%
CSR	604 833	1 046 668,76 €	0,1199%
CTS EVENTIM	476 112	15 511 728,96 €	0,4960%
CUMMINS	17 068	1 995 335,28 €	0,0106%
CVS CAREMARK	371 077	21 268 394,38 €	0,0287%
CVS GROUP	290 091	2 137 988,94 €	0,4113%
CYBERAGENT	33 100	1 120 305,50 €	0,0262%
CYBERDYNE INC	32 300	124 903,62 €	0,0235%
DAH SING BANKING	587 461	907 103,35 €	0,0418%
DAH SING FINANCIAL	129 658	560 634,69 €	0,0387%
DAICEL CHEM.IND.	275 000	2 479 853,80 €	0,0786%
DAIDO METAL	157 100	973 258,00 €	0,3306%
DAIFUKU	73 300	2 933 853,82 €	0,0579%
DAI-ICHI MUTUAL LIFE	52 900	724 618,82 €	0,0044%
DAIICHI SANKYO	30 600	856 609,79 €	0,0043%
DAIKIN INDUSTRIES	20 500	1 911 546,50 €	0,0070%
DAIMLERCHRYSLER	767 154	35 220 040,14 €	0,0717%
DAISEKI	67 800	1 232 523,82 €	0,1577%
DAITO TRUST CONST.	32 000	3 830 946,57 €	0,0423%
DAIWA HOUSE IND.	270 200	7 535 913,93 €	0,0406%
DALATA HOTEL GROUP	1 076 777	5 098 539,10 €	0,5841%
DANAHER	163 600	14 757 846,30 €	0,0235%
DANSKE BANK	27 264	470 935,10 €	0,0030%
DASSAULT AVIATION	8 937	10 813 770,00 €	0,1070%
DASSAULT SYSTEMES	461 919	47 901 000,30 €	0,1758%
DAVIDE CAMPARI	1 731 650	12 788 235,26 €	0,1491%
DBS GROUP HOLDINGS	165 727	2 519 701,33 €	0,0065%
DE LONGHI	57 705	1 275 280,50 €	0,0386%
DECHRA PHARMACEUT	334 616	7 717 175,86 €	0,3263%
DELIVERY HERO AG	4 490	143 231,00 €	0,0024%
DELTA AIR LINES	78 152	3 411 437,52 €	0,0114%
DELTA PLUS GROUP	6 670	212 106,00 €	0,0906%
DENSO	88 500	3 452 623,85 €	0,0112%
DERICHEBOURG	531 206	2 123 761,59 €	0,3241%
DERWENT LONDON	56 357	1 791 393,47 €	0,0505%
DEU.LUFTHANSA NOM.	607 114	11 960 145,80 €	0,1278%
DEUTSCHE BANK NOM.	1 814 554	12 641 997,72 €	0,0878%
DEUTSCHE BORSE	144 139	15 127 388,05 €	0,0759%
DEUTSCHE POST NOM.	520 419	12 443 218,29 €	0,0421%
DEUTSCHE TELEKOM	2 139 421	31 706 219,22 €	0,0449%
DEUTSCHE WOHN.POR.	489 423	19 576 920,00 €	0,1371%
DEUTZ	517 406	2 662 053,87 €	0,4281%

DEVOTEAM	20 393	1 682 422,50 €	0,2446%
DEXCOM	41 848	4 385 592,79 €	0,0471%
DEXUS PTY.UNIT	457 273	2 990 663,42 €	0,0449%
DIA	1 858 639	857 761,90 €	0,2986%
DIAGEO	157 465	4 903 511,50 €	0,0065%
DIASORIN	75 387	5 329 860,90 €	0,1347%
DIGNITY PLC	565 000	4 384 407,55 €	1,1298%
DIRECT LINE INSU GRP	226 103	802 841,36 €	0,0164%
DISCO	5 300	543 012,44 €	0,0148%
DISCOVER FINANCIAL	45 784	2 362 192,47 €	0,0138%
DISNEY WALT-DISNEY	152 800	14 656 449,28 €	0,0103%
DNB NOR	47 268	659 686,75 €	0,0029%
DOLLAR GENERAL	89 190	8 432 537,46 €	0,0339%
DOLLAR TREE	232 266	18 351 279,47 €	0,0976%
DOMETIC GROUP	769 270	4 174 627,53 €	0,2600%
DOMINOS PIZZA ENT	26 065	652 507,85 €	0,0305%
DOMINO'S PIZZA UK	1 000 000	2 597 069,80 €	0,2144%
DONT NOD ENTER	14 927	220 919,60 €	0,3194%
DOVER	20 152	1 250 740,85 €	0,0138%
DOWA HOLDINGS	71 500	1 881 268,40 €	0,1153%
DOWDUPONT INC	657 989	30 782 707,19 €	0,0287%
DOWNER EDI	295 171	1 228 818,80 €	0,0496%
DTS	91 900	2 571 896,03 €	0,3644%
DULUX GROUP	521 880	2 108 346,35 €	0,1341%
DXC TECHNOLOGY CIEA	61 641	2 867 035,80 €	0,0220%
E.ON	2 621 625	22 616 758,87 €	0,1191%
EAGLE INDUSTRY	355 200	3 616 551,33 €	0,7139%
EAST JAPAN RAILWAY	2 800	216 796,75 €	0,0007%
EATON CORP	31 938	1 918 263,64 €	0,0074%
ECOLAB	1 645	212 037,57 €	0,0006%
EDENRED	643 464	20 661 629,04 €	0,2688%
EDF	2 894 937	39 950 130,60 €	0,0962%
EDF PF 20 N	269 457	3 718 506,60 €	0,0090%
EDISON INTL	35 922	1 783 923,32 €	0,0110%
EDP ENER.G.PORUGAL	4 379 838	13 354 126,06 €	0,1198%
EDP RENOVAVEIS	2 613 399	20 319 177,23 €	0,2996%
EIFFAGE	256 779	18 734 595,84 €	0,2620%
ELECTROLUX B	11 798	217 800,28 €	0,0039%
ELECTRONIC ARTS A	5 005	345 487,95 €	0,0017%
ELEKTA S.B	1 050 000	10 914 405,53 €	0,2849%
ELEMENTIS	1 848 915	3 751 182,91 €	0,3186%
ELI LILLY ORD	246 000	24 902 348,77 €	0,0232%
ELIOR	1 334 347	17 426 571,82 €	0,7584%
ELIS	1 407 063	20 472 766,65 €	0,6398%
ELISA CORP.S.A	229 807	8 291 436,56 €	0,1373%
EMS CHEMIE HOL.NOM	387	160 377,14 €	0,0017%
ENAGAS	984 999	23 255 826,39 €	0,4126%
ENEL ENERG.ELET.	2 437 933	12 296 934,05 €	0,0240%
ENGIE	210 941	2 642 036,03 €	0,0087%
ENI	104 237	1 433 050,28 €	0,0029%
ENTERGY	253 151	19 060 234,06 €	0,1398%
ENTERTAINMENT ONE	1 250 000	4 966 297,14 €	0,2697%
EOG RESOURCES	147 300	11 237 399,29 €	0,0254%
EPIROC AKTIEBOLAG	18 458	143 657,33 €	0,0047%
EPIROC AKTIEBOLAG	32 530	269 098,69 €	0,0039%
EQUINIX INC	4 520	1 394 017,58 €	0,0056%
EQUITY RESIDENTIAL	32 628	1 884 069,70 €	0,0089%
ERAMET	3 996	241 158,60 €	0,0150%
ERSTE BANK OSTERR.	203 977	5 925 531,85 €	0,0475%
ESKER	9 347	546 799,50 €	0,1666%
ESSENTA PLC	712 009	2 716 192,77 €	0,2707%
ESSEX PROPERTY TRUST	5 577	1 196 287,60 €	0,0084%
ESSILOR INTL	448 432	49 529 314,40 €	0,1051%
EURAZEO	252 276	15 590 656,80 €	0,3297%

EUROFINS SCIENT.	53 877	17 563 902,00 €	0,3035%
EURONEXT	131 746	6 626 823,80 €	0,1882%
EUROPCAR GROUP	694 494	5 462 195,31 €	0,4313%
EUTELSAT COMM.PROM	1 306 759	22 482 788,61 €	0,5614%
EVEREST REINS.GRP	9 462	1 802 427,61 €	0,0233%
EVOLUTION MINING	1 177 302	2 675 356,81 €	0,0694%
EVONIK INDUSTRIES	592 078	12 907 300,40 €	0,1271%
EVOTEC OAI	221 250	3 842 006,25 €	0,1484%
EXEDY	18 400	394 786,51 €	0,0379%
EXELON	492 946	19 447 898,00 €	0,0510%
EXOR NV	100 484	4 748 873,84 €	0,0417%
EXPERIAN	99 188	2 105 210,18 €	0,0109%
FACEBOOK CL A	131 972	15 133 805,26 €	0,0055%
FAROE PETROLEUM	526 703	862 629,84 €	0,1330%
FAST RETAILING	14 300	6 427 096,96 €	0,0135%
FAURECIA	374 143	12 372 909,01 €	0,2710%
FCC	140 000	2 876 558,65 €	0,2659%
FE NEW N.V.	35 400	3 072 012,00 €	0,0188%
FERGUSON	30 123	1 683 773,51 €	0,0130%
FERROVIAL	462 762	8 188 573,60 €	0,0627%
FIAT CHRYSLER	2 149 057	27 254 340,87 €	0,1386%
FIDELITY NATIONAL	14 403	1 292 068,10 €	0,0044%
FIELMANN	103 165	5 570 910,00 €	0,1228%
FIGEAC AERO	34 000	374 000,00 €	0,1068%
FINANCIERE ODET	4 831	3 845 476,00 €	0,0734%
FINECOBANK	651 243	5 716 611,05 €	0,1070%
FINMECCANICA	530 378	4 072 242,28 €	0,0917%
FIRESTONE DIAMONDS	2 946 539	109 155,39 €	0,5391%
FIRST PACIFIC	4 784 366	1 614 362,36 €	0,1102%
FISHER PAYKEL HEA.	167 657	1 278 473,13 €	0,0292%
FISHER PLC	330 000	6 375 355,13 €	0,6565%
FLETCHER BUILDING	282 811	809 548,15 €	0,0331%
FLIGHT CENTRE	56 335	1 489 036,95 €	0,0557%
FLSMIDTH & CO.B	72 942	2 864 917,04 €	0,1423%
FMC	27 999	1 811 491,09 €	0,0208%
FNAC DARTY	102 000	5 824 200,00 €	0,3834%
FONC.DES REGIONS	220 894	18 599 274,80 €	0,2664%
FONC.FIN.PARTICIP.	63 060	5 057 412,00 €	0,2530%
FORTESCUE METALS	625 687	1 614 502,11 €	0,0203%
FORTIVE	27 051	1 601 076,55 €	0,0081%
FOSTER ELECTRIC	104 900	1 059 699,87 €	0,3895%
FP	30 700	1 644 895,94 €	0,0693%
FRAPORT AG	206 193	12 878 814,78 €	0,2230%
FRASERS CENTREPOIN	116 700	123 579,24 €	0,0040%
FREENET AG	15 791	267 578,50 €	0,0123%
FRESENIUS	142 611	6 043 854,18 €	0,0256%
FRESENIUS MED.CARE	77 059	4 364 621,76 €	0,0250%
FUCHS PETR.ORD.DEM	50 940	1 782 900,00 €	0,0733%
FUCHS PETROLUB PF	5 861	210 878,78 €	0,0084%
FUGRO	83 121	627 231,07 €	0,0983%
FUJI RG REGISTERED	189 100	1 944 966,02 €	0,1933%
FUKUOKA FIN.GRP.	94 300	1 681 932,09 €	0,0548%
FUTURE PLC	670 095	3 568 663,70 €	0,8185%
GALAXY	641 698	3 570 505,57 €	0,0148%
GALLIFORD TRY	300 000	2 082 335,25 €	0,2702%
GALP ENERGIA CL.B	959 616	13 237 902,72 €	0,1157%
GAMA AVIATION	433 914	580 131,25 €	0,6821%
GAMESA CORPORACION	372 580	3 964 251,20 €	0,0547%
GAS NATURAL SDG	696 643	15 507 273,18 €	0,0696%
GAZTRANSPORT TECHN	49 569	3 328 558,35 €	0,1337%
GEA GROUP	98 391	2 213 797,50 €	0,0545%
GECINA NOM.	204 720	23 133 360,00 €	0,2684%
GEMALTO	358 896	18 181 671,36 €	0,3947%
GEN.PROPERTY TRUST	1 565 248	5 147 446,93 €	0,0867%



GENERAL ELECTRIC	1 998 413	13 233 597,00 €	0,0230%
GENMAB	473	67 662,43 €	0,0008%
GENTING SINGAPORE	1 097 400	686 689,34 €	0,0091%
GENUS PLC	309 170	7 392 109,85 €	0,4753%
GERRESHEIMER	33 406	1 912 493,50 €	0,1064%
GILEAD SCIENCES	214 947	11 761 304,16 €	0,0166%
GIVAUDAN NOM.	437	882 608,93 €	0,0047%
GK SPARK PLUG	60 000	1 048 630,73 €	0,0287%
GLANBIA	235 949	3 869 563,60 €	0,0797%
GLAXOSMITHKLINE	298 336	4 956 588,97 €	0,0060%
GLENVEAGH PROPERT	3 777 157	2 666 672,84 €	0,4335%
GLOBAL PAYMENTS	44 887	4 049 509,08 €	0,0284%
GOLDEN AGRI-RESOURCE	2 806 400	441 272,02 €	0,0220%
GOLDMAN SACHS	95 200	13 911 700,13 €	0,0256%
GOODMAN GRP UNIT	167 831	1 098 684,28 €	0,0093%
GPE BRUXEL.LAMBERT	99 915	7 601 533,20 €	0,0619%
GPE EUROTUN.REGPT	2 363 528	27 724 183,44 €	0,4297%
GRAINCORP	29 793	168 248,44 €	0,0130%
GRANDVISION NV	169 085	3 234 596,05 €	0,0665%
GREAT EAGLE HOLD.	341 898	1 279 708,50 €	0,0489%
GREEN REIT PLC	1 686 099	2 276 233,65 €	0,2411%
GRENKELEASING AG	127 924	9 491 960,80 €	0,2760%
GRIFOLS CL.B	568 997	9 183 611,58 €	0,2177%
GRIFOLS CL A	800 629	18 334 404,10 €	0,1879%
GROUPE CRIT	13 310	705 430,00 €	0,1183%
GROUPE DANONE	430 768	26 496 539,68 €	0,0629%
GRUBHUB	23 432	1 574 431,98 €	0,0258%
GUERBET	68 369	3 582 535,60 €	0,5434%
GULF MARINE SERV	3 302 333	382 644,57 €	0,9436%
GUOTAI JUNAN INTER	1 093 002	153 872,56 €	0,0142%
GVC HOLDINGS	443 539	3 330 681,14 €	0,0762%
GYM GROUP PLC	938 599	2 854 855,18 €	0,6803%
HAITONG INTERNATIO	833 525	229 099,12 €	0,0144%
HAKUTO	112 000	1 009 083,83 €	0,4640%
HALMA	626 287	9 517 636,54 €	0,1650%
HAMAMATSU	106 400	3 134 634,07 €	0,0645%
HAMMERSON	39 541	145 115,09 €	0,0052%
HANG LUNG GROUP	210 123	468 132,11 €	0,0154%
HANG LUNG PROPERT.	849 073	1 415 414,17 €	0,0189%
HANG SENG BANK	122 150	2 399 286,05 €	0,0064%
HANNOVER RUCK.NOM.	97 067	11 424 785,90 €	0,0805%
HANSA MEDICAL	66 271	1 809 947,00 €	0,1658%
HANWA	63 600	1 434 567,02 €	0,1502%
HARMONIC DRIVE SYS	49 400	1 185 561,87 €	0,0513%
HARVEY NORMAN	253 997	494 291,49 €	0,0215%
HASEKO	441 800	4 068 538,92 €	0,1469%
HCA HOLDINGS	56 311	6 130 345,06 €	0,0164%
HCP	778 996	19 032 811,34 €	0,1631%
HEALTHSCOPE LTD	505 106	693 673,10 €	0,0290%
HEINEKEN	188 598	14 559 765,60 €	0,0327%
HEINEKEN HOLDING	252 282	18 605 797,50 €	0,0876%
HELLA HUECK	45 369	1 578 841,20 €	0,0408%
HENDERSON LAND	385 354	1 679 168,06 €	0,0088%
HENKEL PF	114 394	10 913 187,60 €	0,0642%
HENKEL POR	381 767	32 736 520,25 €	0,1469%
HERA	3 284 383	8 743 027,54 €	0,2205%
HERMES INTL	80 113	38 838 782,40 €	0,0759%
HEWLETT PACKARD	220 503	3 946 543,66 €	0,0142%
HEXAGON B	12 610	507 634,93 €	0,0036%
HI LEX	160 300	2 786 254,58 €	0,4194%
HILTON WORLDWIDE	59 826	3 757 605,56 €	0,0202%
HINO MOTORS	375 000	3 109 534,55 €	0,0653%
HISCOX	300 000	5 418 082,56 €	0,1042%
HITACHI	409 800	9 591 462,18 €	0,0424%

HKG AND CHINA GAS	3 288 609	5 952 466,25 €	0,0214%
HKG EXCHANGES	59 552	1 507 738,22 €	0,0048%
HOCHTIEF	40 382	4 752 961,40 €	0,0572%
HOME DEPOT	39 397	5 921 526,08 €	0,0035%
HONDA MOTOR	57 800	1 333 927,33 €	0,0032%
HONGKONG ELECTRIC	18 000	109 607,10 €	0,0008%
HOPEWELL HOLDINGS	827 000	3 178 583,60 €	0,0952%
HOSHIZAKI ELECTRIC	32 700	1 741 626,38 €	0,0452%
HOWDEN	1 073 098	5 207 971,58 €	0,1763%
HOYA	15 700	828 057,09 €	0,0041%
HSBC HOLDINGS	940 923	6 781 606,47 €	0,0047%
HUFVUDSTADEN LIB.A	450 000	6 078 441,05 €	0,2217%
HUGO BOSS	109 149	5 885 314,08 €	0,1550%
HUHTAMAKI	372 088	10 072 422,16 €	0,3453%
HUMANA	11 925	2 988 473,95 €	0,0087%
HUNTINGTON BANCSH.	220 201	2 296 108,05 €	0,0210%
HURRICANE ENERGY	1 512 415	744 117,27 €	0,0772%
HUTCHISON PORT HOL	3 727 800	798 942,40 €	0,0428%
HYPO REAL ESTAT.BK	18 977	163 866,40 €	0,0141%
HYPOPORT	27 500	4 075 500,00 €	0,4235%
HYSAN DEVELOPMENT	484 685	2 017 230,58 €	0,0463%
IAC INTERACTIVE CORP	11 000	1 761 308,66 €	0,0142%
IBERDROLA	5 787 823	40 618 941,81 €	0,0905%
IBM	108 765	10 815 131,48 €	0,0120%
IBSTOCK PLC	1 155 793	2 558 699,45 €	0,2844%
ICADE	280 368	18 644 472,00 €	0,3762%
ID LOGISTICS	24 000	2 760 000,00 €	0,4253%
IDEX	13 000	1 435 839,57 €	0,0169%
IG GROUP HOLDINGS	642 131	4 077 930,70 €	0,1741%
IHI	97 200	2 348 224,81 €	0,0628%
IIDA GROUP HOLDING	32 200	488 055,00 €	0,0109%
ILIAD	166 288	20 395 223,20 €	0,2816%
ILLUMINA	16 259	4 265 898,50 €	0,0109%
ILUKA RESOURCES	127 246	597 126,81 €	0,0301%
IMA INDUSTRIA	105 309	5 728 809,60 €	0,2682%
IMCD	231 740	12 977 440,00 €	0,4406%
IMERYS	154 909	6 503 079,82 €	0,1943%
INABA DENKISANGYO	44 800	1 466 297,03 €	0,1593%
INABATA	74 300	829 961,08 €	0,1170%
INCITEC PIVOT	853 945	1 724 928,93 €	0,0532%
INDITEX	360 100	8 048 235,00 €	0,0116%
INFINEON TECHN.	462 399	8 029 558,65 €	0,0407%
INFORMA	60 615	425 598,27 €	0,0048%
ING GROEP	1 947 868	18 329 437,88 €	0,0501%
INGENICO	329 019	16 299 601,26 €	0,5211%
INNOGY SE	166 540	6 783 174,20 €	0,0331%
INNOGY SE	57 414	2 131 207,68 €	0,1098%
INPEX HOLDINGS	454 800	3 559 836,29 €	0,0311%
INSUR.AUSTRAL.GRP	361 046	1 556 424,44 €	0,0156%
INTAGE HOLDINGS IN	27 400	194 870,54 €	0,0661%
INTEGRAFIN HLDG	1 600 000	5 472 675,62 €	0,4829%
INTER PARFUMS	33 000	1 113 750,00 €	0,0768%
INTERCONT HOTEL GRP	8 940	422 024,18 €	0,0048%
INTERCONTINENTALEX	77 049	5 077 287,47 €	0,0135%
INTERTEK GROUP	37 651	2 013 534,62 €	0,0233%
INTERTRUST	200 000	2 938 000,00 €	0,2228%
INTESA SANPAOLO	10 654 793	20 668 167,46 €	0,0609%
INTRUM JUSTITIA	159 941	3 246 163,17 €	0,1216%
INTUIT	37 656	6 484 349,04 €	0,0145%
INTUITIVE SURGICAL	36 454	15 272 317,43 €	0,0319%
INVESTEC	20 412	100 314,56 €	0,0030%
INWIT	1 122 053	6 693 046,15 €	0,1870%
ION BEAM APPLICAT.	121 426	1 559 109,84 €	0,4031%
IPSEN PROMESSE	330 921	37 344 434,85 €	0,3949%

IPSOS	83 033	1 705 497,82 €	0,1869%
IRISH CONTINENTAL	709 415	3 015 013,75 €	0,3729%
IRISO ELECTR	5 300	171 989,15 €	0,0216%
ISS AS TEMP	8 069	196 847,07 €	0,0043%
ISUZU MOTORS	150 000	1 851 967,02 €	0,0177%
ITOCHU	1 103 800	16 431 056,44 €	0,0696%
ITOCHU TECHNO-SOL.	120 000	2 032 200,43 €	0,0500%
IZUMI CO LTD	40 000	1 629 715,03 €	0,0558%
J.HARD.CHESS UNITS	193 456	1 801 363,91 €	0,0437%
JACQUET METAL SCE	73 060	1 133 891,20 €	0,3041%
JARDINE CYCLE	42 017	953 246,45 €	0,0106%
JCDECAUX	295 660	7 249 583,20 €	0,1389%
JERON.MARTINS ESC.	475 231	4 913 888,54 €	0,0755%
JGC	232 900	2 872 702,03 €	0,0899%
JOHN LAING GRP	977 764	3 616 708,24 €	0,1992%
JOHNSON CTRLS INTL	1 196 901	31 044 145,26 €	0,1312%
JOHNSON ELECTRIC LTD	653 839	1 165 932,46 €	0,0739%
JOHNSON JOHNSON	207 201	23 390 884,01 €	0,0077%
JOHNSON MATTHEY PL	47 257	1 473 704,45 €	0,0244%
JPMORGAN CHASE	494 085	42 192 693,61 €	0,0149%
JSP	180 100	3 081 585,42 €	0,5733%
JSR	153 500	2 025 522,90 €	0,0679%
JTC PLC	882 211	3 833 349,56 €	0,7955%
JUPITER FUND MANAG	650 000	2 137 819,62 €	0,1420%
JUST EAT	718 800	4 699 368,72 €	0,1055%
JX HOLDING INC 1 SEC	2 195 200	10 093 803,02 €	0,0648%
K S HOLDINGS	210 000	1 808 313,94 €	0,0892%
K&S NOM	271 269	4 264 348,68 €	0,1417%
KANSAI PAINT	138 800	2 339 511,74 €	0,0509%
KANSAS CITY SOUTHN	20 353	1 699 421,64 €	0,0202%
KAO	8 400	546 110,81 €	0,0017%
KAUFMAN ET BROAD	61 687	2 060 345,80 €	0,2821%
KAWASAKI HEAVY	68 800	1 290 198,51 €	0,0412%
KBC BANCASSURANCE	175 785	9 963 493,80 €	0,0422%
KDDI	158 800	3 322 347,91 €	0,0063%
KENDRION	107 167	2 239 790,30 €	0,7895%
KENMARE RESOURCES	992 982	2 110 314,94 €	0,9060%
KEPPEL	642 600	2 437 355,84 €	0,0355%
KERING	67 690	27 861 204,00 €	0,0536%
KERLINK	1 928	6 902,24 €	0,0379%
KERRY GROUP CL.A	365 140	31 584 610,00 €	0,2071%
KERRY LOGISTIC	890 606	1 156 275,79 €	0,0522%
KERRY PROPERTIES	519 620	1 553 028,16 €	0,0357%
KESKO CL.B	243 992	11 492 023,20 €	0,3573%
KEYCORP	170 832	2 208 718,86 €	0,0168%
KEYENCE	11 000	4 883 404,41 €	0,0090%
KH NEOCHEM CO LTD	60 700	1 114 101,58 €	0,1643%
KIADIS PHARMA	158 913	1 212 506,19 €	0,6529%
KINPOLIS GROUP NV	44 452	2 169 257,60 €	0,1624%
KINGSPAN GROUP	474 424	17 733 969,12 €	0,2630%
KINNEVIK	11 430	241 005,53 €	0,0047%
KINTETSU WORLD EXP	34 800	450 050,11 €	0,0483%
KION GROUP	102 503	4 543 957,99 €	0,0868%
KITZ	150 000	1 026 146,40 €	0,1494%
KIWI PROPERTY	920 498	737 024,74 €	0,0642%
KLEPIERRE	590 479	15 919 313,84 €	0,1878%
KLINGELNBERG LTD	43 469	1 490 883,71 €	0,4917%
KLOCKNER	15 512	94 002,72 €	0,0156%
KOITO MFG	28 500	1 290 696,03 €	0,0177%
KOMATSU	75 000	1 414 539,23 €	0,0077%
KON.BAM GROEP	1 257 449	3 161 226,79 €	0,4511%
KON.BOSKALIS	221 785	4 819 388,05 €	0,1638%
KON.DSM NOM.	184 944	13 212 399,36 €	0,1019%
KON.PHILIPS ELEC.	453 455	14 025 363,15 €	0,0490%

KON.VOLKERWESSELS	250 151	3 459 588,33 €	0,3127%
KONE B	346 365	14 422 638,60 €	0,0766%
KONECRANES A	148 262	3 912 634,18 €	0,1879%
KONINK. AHOLD DELHAI	2 293 018	50 618 372,35 €	0,1937%
KONINKLIJKE KPN	5 052 528	12 934 471,68 €	0,1202%
KONINKLIJKE VOPAK	203 343	8 068 650,24 €	0,1591%
KORIAN PROMESSES	319 220	9 921 357,60 €	0,3894%
KOSE	15 900	2 188 107,70 €	0,0262%
KROGER	227 100	5 463 193,81 €	0,0285%
KRONES HERMANN ORD	35 000	2 362 500,00 €	0,1108%
KUREHA	28 000	1 359 584,18 €	0,1346%
KYORITSU MAINT.	7 800	299 759,13 €	0,0199%
KYOWA EXEO	124 200	2 552 908,73 €	0,1054%
LABORATORY AMERICA	5 097	563 405,43 €	0,0051%
LAGARDERE	929 216	20 461 336,32 €	0,7086%
LAND SECURITIES GRP	152 317	1 365 091,58 €	0,0205%
LANXESS	10 495	421 899,00 €	0,0115%
LAR ESPANA REAL ES	314 907	2 346 057,15 €	0,3323%
LAS VEGAS SANDS	84 032	3 826 151,95 €	0,0107%
LAUDER ESTEE CL.A	29 439	3 350 403,62 €	0,0134%
LE NOBLE AGE	10 996	478 875,80 €	0,1133%
LECTRA	144 860	2 633 554,80 €	0,4549%
LEG IMMOBILIEN	154 344	14 063 825,28 €	0,2443%
LEGAL GL GROUP	281 575	724 681,91 €	0,0047%
LEGRAND PROMESSES	214 955	10 597 281,50 €	0,0804%
LEM HDG SA REGISTER	5 711	5 311 143,85 €	0,5010%
LEND LEASE	127 677	914 449,75 €	0,0226%
LEONI	85 047	2 575 223,16 €	0,2603%
LEOPALACE21	84 800	294 790,25 €	0,0346%
LEOVEGAS	474 215	1 860 363,93 €	0,4665%
LI AND FUNG LTD	3 495 512	480 380,75 €	0,0411%
LIBERTY GLOBAL CL A	56 619	1 022 277,18 €	0,0105%
LINDE PLC	126 897	17 321 443,28 €	0,0230%
LINEDATA SERVICES	56 746	1 787 499,00 €	0,7956%
LINTEC	90 000	1 697 088,28 €	0,1175%
LISI	173 696	3 560 768,00 €	0,3210%
LLOYDS BANKING GRP	455 071	1 019 097,90 €	0,0026%
LLOYDS TSB GROUP	3 497 651	2 020 535,95 €	0,0049%
L'OCCITANE INTL	1 119 702	1 788 991,09 €	0,0758%
LOEW'S	281 580	11 212 458,21 €	0,0896%
LONDON STOCK EXCH.	15 027	680 069,90 €	0,0043%
LONZA GROUP NOM.	3 589	811 179,61 €	0,0048%
LOOMIS	250 000	7 054 760,73 €	0,3479%
LOOPUP GROUP PLC	420 512	1 358 681,74 €	0,7627%
L'OREAL PF 20 N	162 457	32 686 348,40 €	0,0290%
LOWES	86 084	6 955 096,22 €	0,0107%
LULULEMON ATHLETIC	33 474	3 561 013,99 €	0,0275%
LUNDBECK	33 387	1 276 879,55 €	0,0168%
LVMH MOET VUITTON	151 371	39 083 992,20 €	0,0300%
MACAU LEGEND DEVEL	2 579 000	391 886,17 €	0,0411%
MACQUARIE GROUP	31 792	2 127 232,91 €	0,0093%
MAEDA	350 000	2 865 954,34 €	0,1768%
MAGELLAN FINANCIAL	656	9 509,94 €	0,0004%
MAISONS DU MONDE	508 782	8 501 747,22 €	1,1246%
MAISONS FRANCE	50 000	1 602 500,00 €	0,7207%
MAN ORD.	247 277	22 292 021,55 €	0,1754%
MANI	9 900	329 550,86 €	0,0278%
MANITOU BF	50 375	1 128 400,00 €	0,1270%
MAPFRE	522 682	1 212 622,24 €	0,0170%
MARATHON PETROLEUM	70 384	3 633 258,84 €	0,0102%
MARKS SPENCER GRP	409 912	1 128 964,92 €	0,0252%
MARR	315 724	6 503 914,40 €	0,4746%
MARSHAALLS	882 946	4 572 372,58 €	0,4414%
MARUBENI	190 400	1 172 573,27 €	0,0110%

MARUI GROUP	120 000	2 040 811,45 €	0,0537%
MASTERCARD CL.A	58 170	9 599 589,29 €	0,0057%
MATCH GROUP	52 118	1 949 951,33 €	0,0765%
MAXIM INTEGRATED	43 141	1 919 013,12 €	0,0156%
MAZDA MOTOR	99 100	896 809,70 €	0,0157%
MBB	34 670	2 468 504,00 €	0,5253%
MC CARTHY AND STONE	2 154 670	3 329 649,92 €	0,4010%
MCDONALDS	14 970	2 325 349,17 €	0,0019%
MCKESSON	19 582	1 892 335,69 €	0,0100%
MEDIASET	78 080	214 251,52 €	0,0066%
MEDIAWAN	453 278	4 986 058,00 €	1,4596%
MEDIAWAN BSA	137 500	101 750,00 €	0,4428%
MEDIBANK	1 014 522	1 605 691,30 €	0,0368%
MEDIOBANCA	486 513	3 588 519,89 €	0,0548%
MEDTRONIC HOLDINGS	288 603	22 964 028,24 €	0,0215%
MEGGITT	222 917	1 169 783,38 €	0,0287%
MEIJI HOLDINGS	5 459	389 988,57 €	0,0036%
MELCO CROWN ENTER	2	- €	0,0000%
MELCO INTL DEV.	444 571	792 763,60 €	0,0293%
MELEXIS	85 000	4 326 500,00 €	0,2104%
MELROSEINDUSTRIE PLC	234 282	427 687,66 €	0,0048%
MERCADOLIBRE	9 019	2 310 470,32 €	0,0200%
MERCARI INC	17 700	259 952,30 €	0,0122%
MERCIALYS	43 082	515 691,54 €	0,0468%
MERCK AND CO. NEW	346 500	23 160 621,97 €	0,0133%
MERCK KGAA	292 266	26 298 094,68 €	0,2261%
MERCURY NZ LIMITED	1 519 914	3 249 698,81 €	0,1116%
MERIDIAN ENERGY	1 948 439	3 891 620,60 €	0,0760%
MERLIN ENTERTAINMENT	900 175	3 184 285,70 €	0,0881%
MERLIN PROPERTIES	550 000	5 931 750,00 €	0,1171%
MERSEN	124 676	2 929 886,00 €	0,6041%
METRO AG	534 088	7 154 108,77 €	0,1483%
METROPOLE TV	138 490	1 944 399,60 €	0,1096%
METSO	276 736	6 337 254,40 €	0,1841%
MGM CHINA HOLDINGS	594 314	872 531,29 €	0,0156%
MICHELIN	273 011	23 670 053,70 €	0,1518%
MICRO FOCUS INTL	20 661	318 357,34 €	0,0050%
MICROSOFT	603 532	53 624 410,82 €	0,0078%
MILBON	8 600	306 504,43 €	0,0260%
MILLEA HOLDINGS	355 900	14 857 933,34 €	0,0495%
MINTH GROUP	250 000	705 295,44 €	0,0218%
MIRAI INDUSTRY	51 800	1 030 459,88 €	0,2023%
MIRVAC GROUP	1 275 647	1 759 729,82 €	0,0349%
MISUMI CORPORATION	113 900	2 105 984,90 €	0,0402%
MITSUB UF J FINA GP	1 476 700	6 333 220,35 €	0,0108%
MITSUB.ELECTRIC	275 000	2 667 322,86 €	0,0128%
MITSUBISHI	577 200	13 898 375,63 €	0,0363%
MITSUBOSHI BELTING	74 900	1 265 445,82 €	0,2297%
mitsui	153 200	2 064 927,08 €	0,0088%
MITSUI CHEMICALS	275 000	5 446 469,36 €	0,1345%
MITSUI FUDOSAN	200 000	3 898 877,94 €	0,0202%
MIURA	31 400	627 145,28 €	0,0251%
MOBILEONE	547 160	733 924,46 €	0,0591%
MOHAWK INDUSTRIES	89 700	9 177 546,25 €	0,1209%
MONCLER SPA	388 190	11 230 336,70 €	0,1517%
MONDELEZ INTL	444 900	15 579 186,46 €	0,0306%
MONDI	66 452	1 209 396,04 €	0,0181%
MONEY FORWARD INC	14 200	382 113,96 €	0,0653%
MONSTER BEVERAGE	44 425	1 912 783,54 €	0,0080%
MORGAN CRUCIBLE	967 052	2 835 809,55 €	0,3389%
MORGAN STANLEY	75 617	2 622 765,21 €	0,0044%
MORITA	44 800	641 527,28 €	0,0955%
MOTOROLA SOLTN-ED	174 575	17 568 217,64 €	0,1068%
MOWI ASA	18 567	342 688,81 €	0,0036%

MPC CONTAINER SHIP	524 353	1 620 932,12 €	0,6224%
MTG CO LTD	40 700	1 713 401,38 €	0,1025%
MTR	847 040	3 899 157,89 €	0,0138%
MTU AERO ENGINES	105 365	16 689 816,00 €	0,2026%
MUNCHENER RUCKVERS	122 730	23 386 201,50 €	0,0821%
MURATA MFG	101 300	12 078 879,32 €	0,0450%
MUSASHI SEIMITSU I	365 800	4 485 706,11 €	0,5616%
MUSASHINO BANK	72 200	1 463 909,86 €	0,2136%
NABALTEC	81 277	1 763 710,90 €	0,9236%
NAFCO	150 800	1 857 635,94 €	0,5063%
NAKANISHI	381 700	5 684 991,40 €	0,4049%
NAMCO BANDAI	70 000	2 748 748,81 €	0,0315%
NAT.AUSTRALIA BANK	346 134	5 130 832,23 €	0,0125%
NATIONAL GRID RG	63 116	537 387,86 €	0,0019%
NATIXIS	2 806 376	11 559 462,74 €	0,0891%
NCC GROUP PLC	3 000 000	5 859 283,61 €	1,0798%
NEMETSCHKE	17 500	1 675 625,00 €	0,0455%
NEOEN	54 329	1 028 991,26 €	0,0639%
NEOPOST	13 959	332 503,38 €	0,0404%
NESTE OY	701 944	47 282 947,84 €	0,2738%
NESTLE NOM.	167 635	11 870 860,77 €	0,0055%
NETAPP	23 897	1 247 372,60 €	0,0095%
NETFLIX INC	45 875	10 741 287,23 €	0,0105%
NEURONES	133 446	2 522 129,40 €	0,5495%
NEW WORLD DEV.	1 454 807	1 683 971,84 €	0,0143%
NEWCREST MING	273 546	3 672 436,75 €	0,0356%
NEXANS	329 014	8 004 910,62 €	0,7545%
NEXITY	422 474	16 645 475,60 €	0,7527%
NEXON CO LTD	632 900	7 130 303,85 €	0,0708%
NEXT GROUP	6 621	294 406,01 €	0,0048%
NEXTEER AUTOMOTIVE	362 000	451 380,14 €	0,0144%
NEXTERA ENERGY INC	39 100	5 945 293,27 €	0,0082%
NEXUS	115 529	2 830 460,50 €	0,7334%
NFON AG	145 484	1 304 991,48 €	1,0537%
NIDEC	30 900	3 073 475,91 €	0,0104%
NIFCO	122 400	2 537 380,19 €	0,1139%
NIKE CL.B	52 566	3 409 214,22 €	0,0042%
NINTENDO	10 700	2 498 387,43 €	0,0076%
NIP.SUISAN KAISHA	254 000	1 243 463,00 €	0,0813%
NIPPON LIGHT METAL	500 000	889 007,95 €	0,0807%
NIPPON SEIKI	123 200	1 847 695,00 €	0,2023%
NIPPON TELEG.TEL.	175 000	6 253 752,37 €	0,0090%
NISHIO RENT ALL	124 500	3 270 811,76 €	0,4385%
NISSHIN FUDOSAN	408 100	1 480 501,23 €	0,8692%
NITORI CO	24 800	2 714 894,75 €	0,0217%
NITTA CORP	107 200	2 773 577,25 €	0,3541%
NN GROUP N.V.	795 157	27 671 463,60 €	0,2331%
NOBLE ENERGY	83 819	1 375 536,40 €	0,0175%
NOBLE GROUP HLD	976 961	- €	0,0736%
NOHMI BOSAI	60 000	882 151,03 €	0,0986%
NOKIA	3 081 346	15 499 170,38 €	0,0547%
NOKIAN RENKAAT	211 512	5 672 751,84 €	0,1532%
NOMURA HOLDINGS	490 300	1 645 009,48 €	0,0140%
NORDEA HOLDING ABP	146 634	1 079 029,47 €	0,0036%
NORDISKE KABEL	177 475	2 115 444,83 €	0,6543%
NORDSTROM	15 771	643 035,74 €	0,0094%
NORFOLK SOUTHERN	14 847	1 942 195,14 €	0,0055%
NORMA GROUP AG	111 172	4 800 406,96 €	0,3489%
NOVARTIS	107 837	8 042 081,36 €	0,0042%
NOVARTIS ADR	43 830	3 290 077,68 €	0,0017%
NOVO NORDISK AS	86 477	3 452 150,21 €	0,0045%
NOVO NORDISK B ADR	21 428	863 568,18 €	0,0011%
NOVOZYMES B NV	35 404	1 380 112,91 €	0,0146%
NTT DOCOMO	10 600	208 964,71 €	0,0003%

NUFARM	220 072	807 752,88 €	0,0580%
NUTRIEN	30 735	1 263 653,06 €	0,0050%
NVIDIA	26 426	3 086 096,31 €	0,0043%
NWS HOLDINGS	1 773 000	3 181 441,65 €	0,0454%
NXP SEMICONDUCTORS	224 520	14 392 534,31 €	0,0760%
OAKLEY CAPITAL INV	1 231 192	2 386 801,94 €	0,6012%
OBARA GROUP INC	37 600	1 173 681,86 €	0,1802%
OBIC	15 600	1 055 997,93 €	0,0157%
OBRASCON HUARTE	89 024	58 043,65 €	0,0311%
OC OERLIKON CORP.	176 420	1 728 349,28 €	0,0519%
OCCIDENTAL PETROL.	187 282	10 055 871,20 €	0,0248%
OENEO	100 668	877 824,96 €	0,1570%
OIL SEARCH	468 008	2 063 639,17 €	0,0307%
OKINAWA CELLULAR	148 700	4 268 194,96 €	0,5439%
OMV	246 583	9 431 799,75 €	0,0753%
ONCIMMUNE HOLDINGS	543 674	696 590,83 €	0,8822%
ONO PHARMACEUTICAL	55 000	984 486,61 €	0,0101%
OPEN HOUSE CO	103 100	3 049 743,79 €	0,1791%
OPHIR ENERGY PLC	1 308 874	520 603,89 €	0,1851%
ORACLE	357 093	14 103 791,24 €	0,0099%
ORANGE	3 279 555	46 422 101,03 €	0,1233%
OREAL	69 010	13 884 812,00 €	0,0123%
ORICA	286 977	3 048 622,52 €	0,0755%
ORIENTAL METALS	1 172 000	441 293,16 €	0,0146%
ORIGIN ENTERPRISES	536 395	3 073 543,35 €	0,4271%
ORION CL.B	399 034	12 082 749,52 €	0,3832%
ORIX	899 300	11 511 864,86 €	0,0679%
ORKLA S.A	38 542	264 922,10 €	0,0038%
ORORA LTD	1 194 335	2 258 041,91 €	0,0990%
ORPEA	324 407	28 943 592,54 €	0,5023%
OSAKA SEC.EXCHANGE	47 700	676 589,27 €	0,0089%
OSRAM LICHT AG	111 467	4 226 828,64 €	0,1151%
OTSUKA	139 300	3 354 199,11 €	0,0733%
OTSUKA HOLDINGS CO	85 000	3 044 991,78 €	0,0152%
OUTOKUMPU CL.A	44 633	142 602,44 €	0,0107%
OVERS.CHINESE BKG	210 678	1 522 468,49 €	0,0050%
OVS	685 387	749 813,38 €	0,3019%
OW BUNKER AS	41 498	- €	0,1129%
OWENS CORNING	31 460	1 210 349,30 €	0,0288%
OXFORD BIODYNAMICS	575 887	1 347 404,27 €	0,6222%
OZ MINERALS	165 641	897 672,62 €	0,0511%
PACIFIC METALS	44 900	954 057,03 €	0,2293%
PAL	17 700	381 743,21 €	0,0765%
PARAMOUNT BED HDG	7 100	257 856,16 €	0,0230%
PARGESA HOLDING	1 642	103 235,16 €	0,0021%
PAYPAM HOLDING INC	155 157	11 413 333,45 €	0,0132%
PCCW	6 006 369	3 026 622,37 €	0,0778%
PEARSON	142 707	1 492 019,93 €	0,0183%
PERNOD-RICARD	293 449	42 051 241,70 €	0,1106%
PERPETUAL	8 786	175 741,64 €	0,0189%
PERSIMMON	14 580	313 513,45 €	0,0046%
PEUGEOT S.A.	1 435 083	26 757 122,54 €	0,1586%
PFIZER	617 549	23 580 469,63 €	0,0107%
PHILIPS LIGHTING	25 238	516 621,86 €	0,0197%
PHILLIPS 66	217 054	16 357 610,20 €	0,0471%
PIERRE VACANCES	34 000	544 000,00 €	0,3468%
PINGUELY HAULOTTE	51 472	454 497,76 €	0,1641%
PIOLAX	90 000	1 582 274,70 €	0,2293%
PIOVAN	232 181	1 844 445,86 €	0,4332%
PIRELLI & C	42 279	237 185,19 €	0,0042%
PLASTIC OMNIUM	281 309	5 674 002,53 €	0,1893%
PLATINUM AM	34 134	102 162,36 €	0,0058%
PNC FIN.SCES GROUP	152 600	15 606 408,61 €	0,0334%
PORR AG	99 468	1 734 721,92 €	0,3419%

PORSHE AUTOMOBILE	231 741	11 967 105,24 €	0,1513%
POSTE ITALIANE	1 089 221	7 607 119,46 €	0,0834%
POSTNL NV	46 257	92 375,23 €	0,0099%
POXEL SA	96 379	490 569,11 €	0,3727%
PRADA	366 525	1 056 557,15 €	0,0143%
PREMIER OIL	1 736 824	1 287 790,51 €	0,2126%
PRIMA MEAT PACKERS	222 100	3 474 388,20 €	0,4396%
PROACTIS HOLDING	1 930 046	2 935 226,77 €	2,0270%
PROCTER GAMBLE	82 962	6 670 924,24 €	0,0033%
PROSIEBEN NOM.	159 314	2 477 332,70 €	0,0684%
PROTO	14 000	155 492,67 €	0,0669%
PROXIMUS	429 499	10 144 766,38 €	0,1271%
PRUDENTIAL	19 237	300 487,71 €	0,0007%
PRYSMIAN	137 823	2 325 074,01 €	0,0514%
PUBLICIS GROUPE	445 254	22 298 320,32 €	0,1893%
PULTE GROUP INC	29 672	674 605,50 €	0,0106%
PUMA R.RUDOLF ECH.	24 686	10 540 922,00 €	0,1637%
QANTAS AIRWAYS	372 301	1 327 517,42 €	0,0229%
QBE INS.GROUP	397 906	2 474 966,50 €	0,0299%
QIAGEN N.V	302 213	8 969 681,84 €	0,1336%
QUALCOMM	272 806	13 581 235,59 €	0,0225%
RAIFFEIS.INTL BK	406 171	9 016 996,20 €	0,1235%
RAMSAY HEALTH CARE	74 220	2 638 699,72 €	0,0367%
RANDSTAD PROV.DIV.	103 442	4 146 989,78 €	0,0564%
RATHBONE BROTHERS	143 175	3 735 901,62 €	0,2593%
RATIONAL	26 611	13 199 056,00 €	0,2340%
RAYSEARCH LABS B	250 000	2 380 365,07 €	0,9679%
REAL GOLD MINING LTD	90 500	- €	0,0100%
REALESTATE.COM.AU	12 704	578 791,67 €	0,0096%
RECKITT BENCKISER	33 364	2 235 170,54 €	0,0047%
RECORDATI IND.CHI.	476 475	14 432 427,75 €	0,2278%
RECRUIT HOLDINGS	130 100	2 761 834,77 €	0,0077%
RED ELECTRICA CORPOR	1 100 244	21 449 256,78 €	0,2033%
RED HAT	53 569	8 230 642,66 €	0,0303%
REGENERON PHARM.	860	280 986,75 €	0,0008%
REGENERESIS	572 378	695 105,59 €	0,8779%
REGIONS FINANCIAL	149 788	1 753 193,75 €	0,0145%
RELO HOLDINGS	52 700	1 081 138,12 €	0,0345%
RELX PLC	98 452	1 773 134,18 €	0,0050%
REMY COINTREAU	131 548	13 016 674,60 €	0,2582%
RENAULT	332 358	18 130 128,90 €	0,1124%
RENASAS ELECTRO	309 700	1 234 644,68 €	0,0186%
RENISHAW PLC	196 730	9 293 467,77 €	0,2703%
RENTOKIL INITIAL	1 144 250	4 298 825,69 €	0,0621%
REPSOL SA DO 19	653 076	261 230,40 €	0,0419%
REPSOL YPF	681 979	9 602 264,32 €	0,0437%
RESONA HOLDINGS	656 500	2 767 418,38 €	0,0282%
RESTAURANT BRANDS	52 500	2 401 915,76 €	0,0209%
REXEL PROMESSES	1 612 127	14 992 781,10 €	0,5303%
REZIDOR HOTEL	674 094	2 726 971,29 €	0,3865%
RHEINMETALL ORD.	2 660	205 245,60 €	0,0061%
RIGHTMOVE PLC	2 000 000	9 631 775,39 €	0,2241%
RIO TINTO	53 991	2 609 110,59 €	0,0145%
RIO TINTO PLC	26 942	1 142 586,85 €	0,0021%
RIZAP GROUP	66 800	101 728,02 €	0,0120%
RM2 INTERNATIONAL	1 194	838,08 €	0,0030%
ROBERTET	9 339	4 912 314,00 €	0,4320%
ROCHE HOLDING BJ	35 224	7 608 058,92 €	0,0050%
ROCKWELL AUTOMAT.	5 500	723 999,48 €	0,0046%
ROHM	97 500	5 472 780,81 €	0,0877%
ROLLS ROYCE HOLDIN	81 857	756 964,07 €	0,0043%
ROLLS ROYCE INTERIM	3 765 422	4 195,22 €	0,1986%
ROPER TECHNOLOGIES	17 434	4 064 654,40 €	0,0169%
ROSS STORES	108 306	7 882 656,87 €	0,0292%



ROTHSCHILD & CO	42 246	1 303 289,10 €	0,0545%
ROYAL BK SCOT. GRP	526 348	1 270 788,39 €	0,0044%
ROYAL DUTCH SHELL	163 167	4 194 839,88 €	0,0037%
ROYAL DUTCH SHELL	187 779	4 895 580,86 €	0,0050%
ROYAL DUTCH SHELL	91 788	4 678 726,99 €	0,0041%
ROYAL MAIL PLC	325 948	988 139,39 €	0,0326%
RPS GROUP PLC	2 402 810	3 640 824,02 €	1,0627%
RTL GROUP	159 107	7 398 475,50 €	0,1028%
RUBIS	678 969	31 830 066,72 €	0,7013%
RWE	142 300	2 698 719,50 €	0,0247%
RYMAN HEALTHCARE G	64 094	403 783,18 €	0,0128%
RYOHIN KEIKAKU	24 500	5 186 344,84 €	0,0873%
S AND P GLOBAL INC.	30 383	4 516 718,73 €	0,0121%
SA SA INTERNATIONAL	1 173 640	388 147,06 €	0,0379%
SAFRAN	293 430	30 927 522,00 €	0,0717%
SAINSBURY	77 534	228 917,72 €	0,0035%
SAINT MARC HOLDINGS	31 300	611 671,76 €	0,1374%
SAINT-GOBAIN	620 057	18 083 962,42 €	0,1134%
SAIPEM	690 252	2 253 672,78 €	0,0683%
SAKATA INKS	11 200	108 409,54 €	0,0179%
SAKATA SEED	13 900	373 486,99 €	0,0287%
SALESFORCE.COM	92 485	11 081 372,04 €	0,0121%
SALVATORE FERRAGAM	238 097	4 203 602,54 €	0,1411%
SALZGITTER	5 642	144 265,94 €	0,0094%
SAMPO A	236 830	9 096 640,30 €	0,0427%
SAMSONITE INTL SA	525 490	1 306 363,86 €	0,0367%
SAN A	50 000	1 656 425,14 €	0,1563%
SAN.AV.ADR SPONS.	324 118	12 308 063,14 €	0,0129%
SANDS CHINA	361 142	1 384 018,21 €	0,0045%
SANDVIK	132 992	1 657 971,31 €	0,0106%
SANKYU	74 800	2 967 054,08 €	0,1147%
SANOFI AVENTIS	1 656 451	125 327 082,66 €	0,1323%
SANTEN PHARMAC.	16 400	207 385,22 €	0,0040%
SANTOS	223 024	752 661,36 €	0,0107%
SAP SYSTEME ORD.	453 230	39 399 283,90 €	0,0369%
SARTORIUS PRIV.	76 909	8 375 390,10 €	0,2054%
SARTORIUS STEDIM BIO	261 014	22 799 572,90 €	0,2832%
SATO HOLDINGS	41 700	867 775,42 €	0,1194%
SAVANNAH PETROLEUM	4 633 082	1 367 909,01 €	0,5266%
SAWAI PHARM.	45 000	1 876 484,50 €	0,1021%
SBI	321 600	5 536 043,10 €	0,1360%
SBM OFFSHORE	214 743	2 775 553,28 €	0,1044%
SCANDI STANDARD	608 950	3 719 191,42 €	0,9218%
SCHEIN HENRY	247 000	16 965 787,52 €	0,1620%
SCHIBSTED CLASS A	60 393	1 769 311,28 €	0,0559%
SCHIBSTED CLASS B	64 239	1 703 521,91 €	0,0492%
SCHINDLER HOLD.BP	1 926	332 764,40 €	0,0047%
SCHINDLER HOLD.NOM	952	161 018,01 €	0,0014%
SCHLUMBERGER ORD	726 412	22 926 951,81 €	0,0525%
SCHNEIDER ELECTRIC	562 752	33 607 549,44 €	0,0972%
SCHOELLER BLECKM.	35 509	2 036 441,15 €	0,2219%
SCHWAB CHARLES	239 657	8 706 604,74 €	0,0177%
SCOR REGPT	593 766	23 394 380,40 €	0,3075%
SCOUT 24	134 024	5 382 403,84 €	0,1246%
SEB	165 389	18 655 879,20 €	0,3297%
SEB PRIM FID 2020	31 781	3 584 896,80 €	0,0000%
SEEK	49 669	517 551,10 €	0,0141%
SEGRO NV09	47 843	313 747,31 €	0,0047%
SEIBU HOLDINGS INC	325 000	4 959 707,61 €	0,0950%
SEKISUI CHEMICAL	99 600	1 295 221,60 €	0,0202%
SEMBCORP IND.	456 500	744 158,14 €	0,0256%
SEMBCORP MARINE	524 997	518 881,61 €	0,0251%
SEMICONDUCTOR MANUF	1 202 300	920 180,67 €	0,0239%
SEMPRA ENERGY	25 895	2 450 754,54 €	0,0095%

SERIA	36 600	1 085 562,43 €	0,0483%
SERVICENOW	57 175	8 905 225,69 €	0,0319%
Serviceware SE	86 257	1 390 462,84 €	0,8215%
SES GLOBAL FDR	1 597 650	26 696 731,50 €	0,4166%
SEVEN GRP HOLDINGS	36 911	322 329,09 €	0,0109%
SEVERN TRENT	11 487	232 350,83 €	0,0048%
SGS NOM.	265	519 700,06 €	0,0035%
SHAFTESBURY	1 057 387	9 783 966,40 €	0,3440%
SHANGRI LA ASIA	802 269	1 039 794,91 €	0,0224%
SHARINGTECHNOLOGY	15 700	150 089,26 €	0,0854%
SHERWIN-WILLIAMS	5 787	1 991 823,49 €	0,0062%
SHIKOKU CHEMICALS	206 500	1 695 852,44 €	0,3503%
SHIMANO	11 800	1 460 173,64 €	0,0127%
SHIN-ETSU CHEMICAL	201 200	13 693 458,89 €	0,0471%
SHINSEI BANK	101 200	1 056 211,61 €	0,0391%
SHIONOGI	162 100	8 104 954,76 €	0,0500%
SHOP APOTHEKE EUR	54 052	2 032 355,20 €	0,4476%
SHOPIFY A	10 496	1 271 199,06 €	0,0107%
SHOPPING CENT AU	135 977	213 536,98 €	0,0149%
SHOWA DENKO KK	70 000	1 825 057,59 €	0,0468%
SHUI ON LAND	9 051 221	1 759 649,23 €	0,1123%
SHUN TAK HOLDINGS	1 234 474	339 302,25 €	0,0408%
SHURGARD SELF STOR	127 326	3 087 655,50 €	0,1432%
SIA ENGINEERING	414 230	603 473,41 €	0,0370%
SIEMENS	457 664	44 567 320,32 €	0,0538%
SIEMENS HEALTHIN	7 257	265 207,07 €	0,0007%
SIG COMBIBLOC GRP	447 376	4 152 589,37 €	0,1398%
SIIX	135 500	1 544 920,42 €	0,2688%
SIKA AG	67 085	7 417 509,10 €	0,0473%
SIMCORP	225 692	13 476 586,80 €	0,5573%
SIMPLYBIZ GROUP	1 646 461	2 751 408,67 €	2,1531%
SIMS	165 268	1 021 856,58 €	0,0815%
SINGAPORE AIRLINES	316 800	1 915 255,91 €	0,0268%
SINGAPORE AIRPORT	484 107	1 447 831,48 €	0,0434%
SINGAPORE EXCHANGE	391 457	1 796 308,15 €	0,0366%
SINGAPORE POST	2 622 020	1 539 741,55 €	0,1164%
SINGAPORE PRESS	1 045 805	1 577 281,87 €	0,0654%
SINGAPORE TECHN.	965 200	2 161 889,42 €	0,0309%
SINGAPORE TELECOM.	1 686 125	3 170 648,69 €	0,0103%
SINO LAND	699 297	1 048 537,26 €	0,0103%
SJM HLDGS LTD	1 118 749	912 483,89 €	0,0198%
SK KAKEN	5 000	2 033 157,21 €	0,1595%
SKANDINAV. ENSK.A	141 031	1 198 102,53 €	0,0065%
SKANSKA S.B	16 424	228 493,73 €	0,0041%
SKF S.B LIBRE	18 784	249 186,86 €	0,0044%
SKY CITY ENTERT.	220 730	459 638,37 €	0,0323%
SL GREEN REALTY	31 561	2 183 303,92 €	0,0377%
SLIGRO FOOD GROUP	87 071	3 030 070,80 €	0,1967%
SMC	35 900	9 514 505,98 €	0,0533%
SMCP SAS	202 402	2 725 140,53 €	0,2704%
SMITH NEPHEW	42 883	699 467,57 €	0,0049%
SMITH(DS)	1 046 310	3 489 060,03 €	0,0764%
SMITHS GROUP	23 813	361 884,37 €	0,0060%
SMS CO	18 400	253 801,80 €	0,0211%
SMURFIT KAPPA GP	26 849	624 507,74 €	0,0113%
SNAM RETE GAS	7 262 251	27 734 536,57 €	0,2093%
SOCIETE GENERALE A	1 757 673	48 898 462,86 €	0,2176%
SOCIETE LDC	13 029	1 413 646,50 €	0,0768%
SODEXHO PF 2023	10 005	895 447,50 €	0,0000%
SODEXHO ALLIANCE	216 527	19 379 166,50 €	0,1468%
SODEXHO PRIME FIDELI	41 800	3 741 100,00 €	0,0000%
SODEXO PF 2020	10 000	895 000,00 €	0,0000%
SODEXO PRIME	79 083	7 077 928,50 €	0,0000%
SOFTBANK	106 100	6 179 685,65 €	0,0096%

SOITEC SA	120 898	6 117 438,80 €	0,3821%
SOLUTIONS 30	27 520	245 478,40 €	0,0263%
SOLVAY	6 215	542 693,80 €	0,0003%
SOMFY NV	64 048	4 035 024,00 €	0,1731%
SOMPO HOLDING	80 000	2 380 468,30 €	0,0214%
SONIC HEALTHCARE	177 830	2 421 370,43 €	0,0389%
SONOVA HOLDING NOM	2 522	359 422,49 €	0,0039%
SONY	15 600	662 455,24 €	0,0012%
SOPHOS GROUP	755 114	3 185 183,67 €	0,1573%
SOPRA GROUP	108 485	8 749 315,25 €	0,5280%
SOUTHWEST AIRLINES	328 600	13 360 738,31 €	0,0584%
SPARK NEW ZEALAND	325 750	792 974,25 €	0,0177%
SPIE	874 905	10 140 148,95 €	0,5625%
SPIRAX-SARCO ENG PLC	37 500	2 607 097,10 €	0,0509%
SPIRIT AEROSYSTEMS	30 498	1 923 282,88 €	0,0286%
SPLUNK INC	33 700	3 090 972,31 €	0,0228%
SQUARE CL A	38 072	1 868 047,48 €	0,0123%
SRA HOLDINGS	25 100	524 931,69 €	0,1647%
SRP GROUP	118 000	284 380,00 €	0,2331%
ST. JAMES S PLACE	1 240 481	13 046 783,63 €	0,2343%
STABILUS GMBH	87 910	4 821 863,50 €	0,3559%
STANDARD ABER BK PLC	123 820	354 195,14 €	0,0049%
STANDARD CHARTERED	139 979	950 244,61 €	0,0042%
STANLEY BLACK DECKER	157 014	16 446 534,89 €	0,1039%
STARHUB	933 642	1 048 598,34 €	0,0539%
STARTS	233 500	4 533 322,65 €	0,4324%
STATE STREET	273 563	15 093 048,52 €	0,0720%
STATOILHYDRO	53 567	994 361,54 €	0,0016%
STEF TFE	42 123	3 243 471,00 €	0,3199%
STEMMER IMAGING AG	48 806	1 827 296,64 €	0,7509%
STMICROELECTRONICS	1 239 288	15 472 510,69 €	0,1360%
STOCKLAND	532 193	1 153 663,85 €	0,0221%
STORA ENSO S.R	1 959 963	19 766 226,87 €	0,3201%
STRATEC BIOMEDICAL	94 933	4 775 129,90 €	0,7931%
STRYKER	58 777	8 059 567,64 €	0,0157%
SUDZUCKER	416 726	4 706 920,18 €	0,2041%
SUEZ ENVIRON.COMP.	1 323 432	15 259 170,96 €	0,2130%
SUMCO	275 000	2 690 345,37 €	0,0938%
SUMI MITSUI FIN GP	615 700	17 893 589,33 €	0,0440%
SUMI MITSUI TRU HLG	97 800	3 136 257,41 €	0,0251%
SUMITOMO	122 100	1 520 156,96 €	0,0098%
SUMITOMO REALTY	29 300	940 528,96 €	0,0062%
SUMITOMO FORESTRY	219 200	2 516 713,75 €	0,1200%
SUMMIT INTERNAT	1 149 116	- €	0,0140%
SUN ART RETAIL GRO	2 437 500	2 173 287,60 €	0,0256%
SUN FRONT.FUDOSAN	214 200	1 817 154,58 €	0,4393%
SUN HUNG KAI PROP.	230 429	2 873 234,12 €	0,0080%
SUNCORP GROUP	197 719	1 537 868,56 €	0,0152%
SUZUKI MOTOR	185 900	8 251 471,25 €	0,0379%
SVB FINANCIAL GROUP	3 171	526 821,78 €	0,0060%
SVENSKA HANDEL FONDE	75 217	729 534,40 €	0,0039%
SWATCH GROUP NOM.	2 675	134 830,06 €	0,0022%
SWATCH GROUP POR.	1 515	385 438,37 €	0,0049%
SWEDBANK A	54 937	1 071 908,41 €	0,0049%
SWIRE PACIFIC CL.A	235 500	2 176 036,16 €	0,0260%
SWIRE PACIFIC CL.B	1 452 500	2 119 478,44 €	0,0487%
SWIRE PROPERTIES	718 526	2 207 724,45 €	0,0123%
SWISS LIFE HO.NOM.	1 571	527 802,47 €	0,0046%
SWISS PRIME SITE	3 708	261 754,73 €	0,0049%
SWISS RE	27 884	2 229 928,19 €	0,0082%
SWISSCOM NOM.	3 808	1 587 201,70 €	0,0074%
SWORD GROUP	77 350	2 243 150,00 €	0,8104%
SYDNEY AIRPORT UNITS	316 712	1 312 644,27 €	0,0140%
SYMRISE	197 960	12 768 420,00 €	0,1525%

SYNCHRONY FCIAL	499 600	10 252 911,69 €	0,0695%
SYNERGIE	114 980	2 811 261,00 €	0,4720%
SYNTHOMER	637 811	2 539 732,06 €	0,1877%
SYSMEX	7 800	328 118,09 €	0,0037%
T AND D	247 900	2 528 004,55 €	0,0378%
T&K TOKA	134 700	1 083 651,26 €	0,5376%
TABCORP HOLDINGS	600 983	1 587 767,63 €	0,0298%
TAIYO INK MFG	63 100	1 557 115,37 €	0,2186%
TAKAMATSU	55 100	1 211 209,15 €	0,1417%
TAKEAWAY.COM B.V.	253 396	14 899 684,80 €	0,4906%
TAKEDA PHARMA.	117 900	3 482 834,17 €	0,0075%
TAKKT	155 878	2 126 175,92 €	0,2376%
TALANX AG	192 219	5 728 126,20 €	0,0760%
TARGET	33 005	1 908 148,93 €	0,0063%
TARKETT SA	354 014	6 202 325,28 €	0,5556%
TAYLOR WIMPEY	154 360	234 321,76 €	0,0047%
TD AMERITRADE HLDG	62 808	2 690 005,41 €	0,0112%
TDK	108 300	6 666 172,33 €	0,0836%
TE CONNECTIVITY LTD	14 229	941 380,63 €	0,0042%
TEAM17 GROUP	1 310 272	2 846 671,94 €	0,9980%
TECHNICOLOR	3 647 455	3 479 672,07 €	0,8800%
TECHNIPFMC P.L.C.	1 048 457	18 370 983,99 €	0,2323%
TECHNO ASSOCIE	16 900	154 419,49 €	0,0843%
TECHNOGYM SPA	360 374	3 373 100,64 €	0,1793%
TECHTRONIC INDUST.	414 070	1 924 583,61 €	0,0227%
TED BAKER	163 380	2 821 447,27 €	0,3666%
TEIKOKU SEN I	70 000	1 212 798,21 €	0,2572%
TEL.ERICSSON S.B	291 237	2 239 090,98 €	0,0095%
TELE COLUMBUS	946 269	2 744 180,10 €	0,7418%
TELE2 AB-B	238 979	2 663 313,08 €	0,0359%
TELECOM ITAL.EPAR.	19 755 846	8 238 187,77 €	0,3277%
TELECOM ITAL.ORD.	13 563 503	6 555 241,00 €	0,0892%
TELEFONICA	3 024 357	22 195 756,03 €	0,0582%
TELEFONICA DEUTSCH	2 875 166	9 827 317,39 €	0,0967%
TELEKOM AUSTRIA	813 373	5 400 796,72 €	0,1224%
TELENET GROUP HOLD	214 530	8 709 918,00 €	0,1824%
TELENOR	37 116	628 052,03 €	0,0025%
TELEPERFORMANCE	294 415	41 100 334,00 €	0,5095%
TELEPIZZA GROUP	433 909	2 555 724,01 €	0,4308%
TELSTRA	2 092 651	3 672 900,20 €	0,0176%
TEMP HLDGS	175 000	2 282 717,29 €	0,0739%
TENARIS	785 357	7 413 770,08 €	0,0665%
TENCENT HOLDINGS	254 500	8 787 223,90 €	0,0027%
TERNA	4 863 277	24 087 810,98 €	0,2420%
TERUMO	11 800	585 574,79 €	0,0031%
TESCO	472 143	999 993,14 €	0,0048%
TESLA MOTORS	20 193	5 878 695,18 €	0,0118%
TESSI	21 831	2 532 396,00 €	0,7768%
TEXAS INSTRUMENTS	27 607	2 282 169,01 €	0,0029%
TF1	262 007	1 855 009,56 €	0,1248%
THALES	146 377	14 930 454,00 €	0,0687%
THE LINK REIT	280 792	2 487 869,54 €	0,0133%
THE MOSAIC	41 263	1 054 360,52 €	0,0107%
THE STAR ENTER GP	330 577	928 335,46 €	0,0360%
THERMO FISHER	15 504	3 035 157,38 €	0,0039%
THULE GROUP AB	373 707	5 977 099,63 €	0,3621%
THYSSENKRUPP	287 365	4 304 727,70 €	0,0462%
TINGYI HOLDING	1 823 833	2 131 505,41 €	0,0325%
TOCALO	114 200	773 044,64 €	0,1807%
TOKAI CARBON	150 000	1 492 576,58 €	0,0667%
TOKAI CORP	49 000	1 089 620,77 €	0,1360%
TOKAI TOKYO SECU.	470 700	1 763 895,43 €	0,1740%
TOKYO ELECTRON	16 700	1 666 395,58 €	0,0101%
TOKYO GAS	190 000	4 219 757,98 €	0,0421%

TOKYO SEIMITSU	119 400	2 639 884,80 €	0,2870%
TOKYO STEEL MFG	473 400	3 359 301,93 €	0,3053%
TOLL BROTHERS	34 670	998 716,79 €	0,0238%
TOMOKU	60 200	813 093,85 €	0,3112%
TOMRA SYSTEMS	85 700	1 686 511,93 €	0,0579%
TOMTOM	482 772	3 813 898,80 €	0,2052%
TOPCON	75 200	877 188,53 €	0,0696%
TOPRE	307 200	5 366 539,98 €	0,5687%
TORAY INDUSTRIES	400 000	2 462 113,51 €	0,0245%
TOTAL FINA	2 278 878	105 238 586,04 €	0,0863%
TOWNGAS CHINA	2 833 816	1 839 574,86 €	0,1008%
TOYOTA INDUSTRIES	129 000	5 235 260,21 €	0,0396%
TOYOTA MOTOR	87 600	4 474 266,21 €	0,0027%
TPR CO LTD	108 700	1 943 103,49 €	0,3011%
TRADE DESK CL A	16 193	1 644 018,35 €	0,0447%
TRANSURBAN UNIT	272 771	1 957 003,42 €	0,0102%
TREASURY WINE EST	134 422	1 225 178,96 €	0,0187%
TREND MICRO	22 600	1 075 755,44 €	0,0161%
TRIGANO	33 517	2 703 146,05 €	0,1733%
TRYGVESTA A/S NV	118 220	2 596 500,88 €	0,0391%
TSUBAKI NAKASHIMA	64 900	838 800,13 €	0,1596%
TSUBAKIMOTO CHAIN	55 000	1 585 264,63 €	0,1437%
TSUKADA GLOBAL HOL	122 100	565 617,16 €	0,2494%
TSURUHA	6 200	465 664,76 €	0,0126%
TUI NOM.	23 651	295 785,73 €	0,0040%
TV BROADCASTS	579 159	958 993,58 €	0,1322%
TWITTER	56 085	1 410 036,22 €	0,0074%
TYMAN	735 169	1 924 847,81 €	0,3746%
TYSON FOODS CL.A	123 781	5 782 185,54 €	0,0419%
U S BANCORP	800 377	31 996 876,08 €	0,0498%
UBI BANCA	1 808 450	4 580 803,85 €	0,1580%
UBI SOFT ENTERTAIN	268 696	18 937 694,08 €	0,2378%
U-BLOX HOLDING	37 245	2 609 364,40 €	0,5246%
UBS NOM.	266 905	2 897 846,02 €	0,0069%
UCB	496 826	35 423 693,80 €	0,2554%
UMICORE	613 015	21 369 702,90 €	0,2488%
UNI CHARM	149 600	4 245 123,81 €	0,0241%
UNIBAIL RODAMCO SE	98 419	13 325 932,60 €	0,0712%
UNICREDIT SPA	1 589 276	15 724 296,74 €	0,0713%
UNILEVER	56 691	2 595 008,34 €	0,0049%
UNILEVER	618 247	29 317 272,74 €	0,0361%
UNION PACIFIC ORD.	20 637	2 495 431,49 €	0,0028%
UNIPER SE	301 126	6 805 447,60 €	0,0823%
UNIPOL	536 223	1 886 432,52 €	0,0747%
UNIPOLSAI S.P.A.	366 590	724 565,14 €	0,0130%
UNI-PRESIDENT CHINA	1 831 000	1 391 127,52 €	0,0424%
UNITED ARROWS	45 000	1 261 155,46 €	0,1489%
UNITED DRUG	612 417	4 073 454,95 €	0,2462%
UNITED OVS BK LCL	122 701	1 934 835,27 €	0,0074%
UNITED PARCEL CL.B	16 191	1 381 365,73 €	0,0023%
UNITED TECHNO.	204 079	19 009 169,33 €	0,0236%
UNITED UTILITIES	163 140	1 338 127,88 €	0,0239%
UNITEDHEALTH GROUP	85 349	18 599 608,87 €	0,0089%
UPM KYMMENE	1 224 292	27 118 067,80 €	0,2294%
UTD INTERNET NOM.	6 240	238 368,00 €	0,0030%
UZABASE INC	21 100	279 268,10 €	0,0683%
VALEO	460 981	11 759 625,31 €	0,1919%
VALLOUREC	166 292	270 307,65 €	0,0363%
VALMET OY	198 611	3 565 067,45 €	0,1325%
VEEVA SYSTEMS A	20 236	1 581 139,41 €	0,0162%
VENTURE CORP.	62 979	563 846,26 €	0,0219%
VEOLIA ENVIRON.	1 200 230	21 550 129,65 €	0,2122%
VERBUND	310 231	11 553 002,44 €	0,1822%
VERIZON CIONS	724 676	35 639 491,51 €	0,0175%

VERTEX PHARM.	65 581	9 506 563,01 €	0,0257%
VESTAS WIND SYST.	19 125	1 261 169,25 €	0,0093%
VETO PROMESSES	32 165	1 633 982,00 €	0,2707%
VICAT	29 845	1 237 373,70 €	0,0665%
VICINITY CENTERS	133 120	213 149,40 €	0,0035%
VICTORIA	225 217	1 179 343,66 €	0,1796%
VICTREX PLC	168 663	4 299 492,44 €	0,1957%
VIENNA INSUR.GROUP	214 992	4 360 037,76 €	0,1680%
VIFOR PHARMA RG	9 769	926 706,98 €	0,0150%
VINCI	772 438	55 630 984,76 €	0,1291%
VIRGIN AUS INT HLG	441 960	- €	0,0000%
VISA INC LTD	205 046	23 665 983,68 €	0,0117%
VITROLIFE AB	400 000	5 801 677,36 €	0,3685%
VIVENDI UNIVERSAL	1 583 102	33 688 410,56 €	0,1212%
VIVO ENERGY PLC	1 029 422	1 433 655,51 €	0,0857%
VMWARE A	48 924	5 868 825,72 €	0,0445%
VOCUS COMMUNICATIO	90 228	177 811,06 €	0,0145%
VODAFONE GROUP	1 229 991	2 095 321,98 €	0,0046%
VOESTALPINE	216 960	5 662 656,00 €	0,1230%
VOLKSWAGEN ORD.	33 936	4 720 497,60 €	0,0115%
VOLKSWAGEN PF	204 764	28 445 814,88 €	0,0993%
VOLVO S.B	142 759	1 633 241,84 €	0,0087%
VONOVIA	570 941	22 603 554,19 €	0,1102%
VTECH HOLDINGS	302 753	2 191 962,64 €	0,1203%
VULCAN MATERIALS	183 100	15 824 939,86 €	0,1387%
VZ HOLDING	40 891	9 615 862,10 €	0,5111%
WACKER CHEMIE	22 050	1 744 155,00 €	0,0423%
WALGREEN	36 730	2 195 478,20 €	0,0039%
WALLIX GROUP	20 658	258 225,00 €	0,3591%
WALMART	113 312	9 233 270,17 €	0,0039%
WANT WANT CHINA	3 271 465	2 003 053,38 €	0,0263%
WARTSILA	379 411	5 271 915,85 €	0,0641%
WASH TEC	65 670	3 966 468,00 €	0,4698%
WASTE CONNECTIONS	61 550	3 997 802,13 €	0,0234%
WASTE MANAGEMENT	14 200	1 105 417,49 €	0,0033%
WATERS	6 350	1 047 918,03 €	0,0084%
WAYFAIR A	14 434	1 137 396,42 €	0,0234%
WELLCARE HEALTH	9 880	2 040 475,18 €	0,0198%
WELLS FARGO	599 353	24 159 722,03 €	0,0131%
WENDEL INVEST.	91 871	9 618 893,70 €	0,1985%
WESFARMERS	104 373	2 071 005,09 €	0,0092%
WEST JAPAN RAILWAY	60 000	3 712 784,25 €	0,0312%
WESTPAC BANKING	361 874	5 580 320,83 €	0,0105%
WESTROCK CO	35 741	1 180 580,12 €	0,0140%
WESTWING GROUP	135 714	2 366 037,88 €	0,6543%
WH GROUP	2 873 416	1 935 911,52 €	0,0196%
WHARF HOLDINGS	757 613	1 726 820,80 €	0,0249%
WHARF REAL ESTATE	204 613	1 071 056,80 €	0,0067%
WHEELLOCK	200 278	1 001 373,22 €	0,0098%
WHIRLPOOL	58 530	5 471 811,31 €	0,0915%
WIENERBERGER	260 771	4 693 878,00 €	0,2219%
WILLIAM DEMANT HLD	5 686	140 884,21 €	0,0023%
WILMAR INTL	996 900	1 996 167,25 €	0,0158%
WIRECARD	172 216	22 870 284,80 €	0,1394%
WIZZ AIR HOLDINGS	91 693	2 862 501,10 €	0,1260%
WM.MORRIS.SUPERM.	523 467	1 243 711,64 €	0,0221%
WOLTERS KLUWER	226 970	11 725 270,20 €	0,0811%
WOODSIDE PETROLEUM	153 617	2 962 978,47 €	0,0164%
WOOLWORTHS	327 881	5 940 546,26 €	0,0249%
WORKDAY CL A	24 203	3 380 776,84 €	0,0160%
WORLDLINE	211 520	8 926 144,00 €	0,1159%
WORLDPAY INC	55 278	3 695 838,29 €	0,0183%
WORLEYPARSONS	96 840	681 064,66 €	0,0210%
WPP PLC	60 720	572 731,90 €	0,0048%

WYNDHAM HTL	25 160	998 564,67 €	0,0254%
WYNDHAM WORLDWIDE	31 133	976 080,76 €	0,0319%
WYNN MACAU LTD	354 719	676 927,26 €	0,0068%
XEBIO	21 500	217 193,02 €	0,0449%
XERO LIVE LIMITED	41 962	1 085 874,64 €	0,0298%
X-FAB SILICON FOUN	414 129	1 764 189,54 €	0,3167%
XILAM ANIMATION	11 907	448 298,55 €	0,2424%
XINYI GLASS HLDGS	520 666	503 786,81 €	0,0130%
XINYI SOLAR HLDG	2 300 000	706 692,07 €	0,0300%
XXL	511 853	1 349 601,04 €	0,3680%
YAMATO KOGYO	110 400	2 264 851,02 €	0,1631%
YOKOGAWA BRIDGE	150 000	1 951 830,92 €	0,3292%
YUE YUEN IND.	1 190 939	3 333 242,68 €	0,0737%
ZALANDO	43 901	985 138,44 €	0,0175%
ZARDOYA OTIS	163 678	1 016 440,38 €	0,0348%
ZENRIN	19 200	356 381,36 €	0,0335%
ZIGEXN CO LTD	206 500	834 754,55 €	0,1850%
ZURICH FINANC.SCES	11 546	3 003 046,06 €	0,0076%

## OBLIGATIONS

**Encours sous gestion dans la poche**

**13 230 436 835 €**

Libellé des valeurs	Quantité de titres	Valeur des titres au 31/12/2018
21ST CEN 3700 150924	1 025 000	917 599,83 €
21ST CENTURY FOX	1 025 000	996 240,11 €
2I RETE 2195 0925	4 000 000	4 020 826,87 €
2I RETE GAS 1.75 26	800 000	769 349,59 €
3M CO 1.875% 11/21	1 025 000	1 079 121,56 €
A2A SPA 1.75% 2025	1 400 000	1 433 430,47 €
AB 1150 0127	25 770 000	25 012 626,48 €
AB 2000 0135	1 700 000	1 590 705,15 €
ABB FIN 0750 160524	400 000	404 923,57 €
ABBEY NAT 0.875% 20	3 568 000	3 602 852,69 €
ABBEY NATL 1.125% 22	680 000	693 460,44 €
ABBEY NATL 2.625%20	11 670 000	12 212 960,11 €
ABBOTT 0000 0920	16 620 000	16 532 610,38 €
ABBOTT 0875 0923	5 495 000	5 498 177,29 €
ABBOTT 1500 0926	2 632 000	2 634 895,71 €
ABBOTT 2.9% 16-21	2 400 000	2 084 573,33 €
ABBOTT 3.4% 16-23	6 195 000	5 403 610,86 €
ABBOTT 3750 1126	1 587 000	1 377 076,33 €
ABBVIE 4250 1128	420 000	362 084,28 €
ABBVIE 2.85 05/23	2 100 000	1 771 996,89 €
ABBVIE 3750 1123	590 000	518 485,44 €
ABBVIE INC 0.375% 19	15 280 000	15 329 088,58 €
ABBVIE INC 2.9% 2022	1 910 000	1 634 116,68 €
ABERTI 1000 270227	7 400 000	6 679 045,02 €
ABERTIS IN 3.75 23	2 500 000	2 808 077,07 €
ABN 6.375% 2021	900	1 057 135,63 €
ABN AMRO 2.875%25	6 000 000	6 254 898,91 €
ABN AMRO 0500 170723	10 026 000	9 980 038,48 €
ABN AMRO 5750 1299	1 800 000	1 862 838,89 €
ABN AMRO BANK 0.25%	16 106 000	16 100 843,33 €
ABN AMRO BANK EUR3M+	4 302 000	4 302 913,46 €
ABN AMRO BK 0.625%22	4 505 000	4 564 521,65 €
ABN AMRO BK 2.5% 23	7 000 000	7 625 586,22 €
ACCOR 1.25% 0124	2 600 000	2 619 781,52 €
ACCOR 2.375% 23	5 000 000	5 306 700,49 €
ACE HLD 3.35% 24	4 275 000	3 725 780,08 €
ACE INA 2.875% 22	9 805 000	8 528 730,34 €
ACEA 3% 16-2026	3 200 000	2 883 585,30 €
ACEA SPA 2.625% 24	3 200 000	3 362 896,52 €
ACEIM 1.5 080627	3 700 000	3 425 434,99 €

ACEIM EU3M+37 080223	2 400 000	2 277 053,87 €
ACHMEA 4.25% 15-2049	1 200 000	1 210 528,77 €
ACHMEA BV 2.5% 20	2 970 000	3 100 481,58 €
ACHMEA BV 6% 43	1 695 000	1 898 469,66 €
ACS SERV 1875 200426	1 600 000	1 497 989,96 €
ACTAVIS FU 3.45%2022	7 005 000	6 087 728,91 €
ACTAVIS FUND 3.85%24	2 120 000	1 830 629,23 €
ADECCO INT 1.50% 22	6 517 000	6 771 296,12 €
ADL RE ES 1.875 0423	4 900 000	4 648 158,80 €
ADLER REAL 2.12 24	2 493 000	2 368 026,25 €
ADO PROPERTIES	1 800 000	1 698 815,59 €
ADP INC 2.25% 20	3 300 000	2 882 430,13 €
ADT CORP 6.25 21	1 325 000	1 182 052,85 €
AEGON NV 1% 23	6 500 000	6 578 326,49 €
AEGON NV 4% 2044	1 000 000	1 035 851,03 €
AERC 4625 0722	1 925 000	1 684 881,35 €
AERCAP 3300 0123	2 582 000	2 174 008,69 €
AERCAP CAP 4.25 20	5 230 000	4 585 719,77 €
AERCAP IRE 3.50 0522	1 425 000	1 211 000,34 €
AERCAP IRE 4.5 0521	4 980 000	4 390 624,85 €
AERCAP IRLD 4.125 23	4 425 000	3 778 639,94 €
AERO PARIS 2125 1038	2 000 000	2 068 885,83 €
AERO ROMA 1625 0627	1 850 000	1 757 573,62 €
AEROPORTI 3.25% 21	1 469 000	1 571 687,33 €
AETNA INC 2.75%22	900 000	756 803,57 €
AHO DELH E3M 0321	2 500 000	2 495 125,00 €
AHODELHAI 1.125 0326	3 600 000	3 565 330,40 €
AHOLD DEL 0875 0924	900 000	899 465,22 €
AIB 2250 0725	2 000 000	1 968 586,13 €
AIG 4200 0428	685 000	582 367,34 €
AIG 6.40 15/12/20	3 437	3 176 898,64 €
AIR LEAS C9 2.5 0321	4 535 000	3 896 383,70 €
AIR LEASE 2.125% 20	1 035 000	901 379,08 €
AIR LEASE 2.75 0123	1 690 000	1 417 038,47 €
AIR LEASE 3.375% 21	1 375 000	1 192 773,26 €
AIR LEASE 3.75% 2022	1 300 000	1 140 555,77 €
AIR LEASE 3500 0122	8 375 000	7 301 965,22 €
AIR LEASE 4.25 24	1 375 000	1 187 492,89 €
AIR LIQ 1.75% 270921	960 000	808 625,99 €
AIR LIQFIN 1.25 25	30	3 102 898,10 €
AIR LIQUIDE 2.25% 23	3 045 000	2 532 345,76 €
AIRL 2625 0722	5 075 000	4 225 663,17 €
AIRLE 3875 0723	2 100 000	1 797 992,39 €
AKELI 1750 0225	3 616 000	3 522 414,01 €
ALCOA 6750 300924	1 625 000	1 474 600,61 €
ALD 0875 0722	17 700 000	17 418 063,25 €
ALD SA 1250 111022	7 900 000	7 853 838,02 €
ALD SA E3M 0721	1 500 000	1 472 014,08 €
ALEX 4000 0124	7 860 000	7 071 444,51 €
ALEXAN 4600 010422	2 000 000	1 818 861,14 €
ALEXANDRIA 3.9%2023	2 000 000	1 762 218,43 €
ALFA SAB 5.25% 24	750 000	660 564,01 €
ALIBABA 2800 0623	575 000	486 432,45 €
ALIMEN 3550 0727	6 000 000	4 985 812,59 €
ALLEMAGN 1% 15/08/24	40 688	43 654,63 €
ALLEMAGNE 1.5% 23	46 800 000	51 151 846,68 €
ALLEMAGNE 4,75%34	10 000 000	16 532 860,69 €
ALLERGA 1500 151123	1 227 000	1 237 990,73 €
ALLERGAN 2625 1128	5 338 000	5 391 149,78 €
ALLIAND 1625 0625	400 000	389 176,82 €
ALLIANDER 0.875 0426	3 000 000	3 026 540,96 €
ALLIANZ 025 06/06/23	3 000 000	2 978 109,62 €
ALLIANZ 2.241% 07/45	5 300 000	5 267 564,57 €
ALLIANZ 5.75% 2041	180	20 455 412,94 €



ALLIANZ SE 4.75%2049	500 000	553 308,21 €
ALLIED 4125 1125	3 160 000	3 223 372,29 €
ALLSTATE 5.75% 2053	2 395 000	2 070 851,45 €
ALLY FCIAL 4.125% 20	3 500 000	3 046 885,26 €
ALLY FINANCIAL 3.75	2 225 000	1 937 145,55 €
ALSTOM S 3% 19	2 000 000	2 057 604,66 €
ALSTRIA 2.125% 23	100 000	104 245,63 €
ALSTRIA OFF 1.5 1127	3 500 000	3 161 282,95 €
ALTERA 4100 1123	2 000 000	1 820 227,73 €
AM AIRLN 3.20% 28	1 350 000	996 529,39 €
AM TOWER 3375 151026	1 855 000	1 527 379,08 €
AMAD IT GP 1.5 0926	900 000	889 546,73 €
AMADEUS 0.125% 20	5 000 000	4 992 981,97 €
AMADEUS CAP 1.625%21	2 800 000	2 892 532,62 €
AMADEUS IT G 0923	200 000	199 164,43 €
AMAZON 2.8 0824	7 770 000	6 666 702,07 €
AMAZON 3.15 0827	8 650 000	7 384 923,79 €
AME TOW 4.40 150226	415 000	367 354,48 €
AMER 5.04999 09/20	2 100	1 911 656,54 €
AMER AIRLN 3.70 28	1 500 000	995 522,73 €
AMER INTL 3.30% 2021	5 360 000	4 717 884,67 €
AMER INTL 4.875%2022	1 800 000	1 637 066,00 €
AMER INTL GP3.9 0426	3 475 000	2 944 992,71 €
AMER TOWER 5% 24	1 670 000	1 541 452,68 €
AMERI EXR 2.375 0520	1 750 000	1 517 020,25 €
AMERIC MOV 1.5 0324	5 630 000	5 790 141,81 €
AMERIC TOW 3.30% 21	7 000 000	6 165 070,20 €
AMERIC TOWER 3.5% 23	374 000	326 693,41 €
AMERICA LIBUS 030519	2 500 000	2 197 637,28 €
AMERICA MOV 4.125%19	6 983	7 265 119,89 €
AMERICAN 0625 221121	6 000 000	6 050 533,67 €
AMERICAN 3000 0623	7 000 000	5 877 942,52 €
AMERICAN 3300 030527	10 865 000	9 268 634,34 €
AMERICAN 3400 270223	2 450 000	2 146 308,45 €
AMERICAN EQUITY	4 632 000	3 914 559,66 €
AMERICAN HONDA F	1 700 000	1 701 771,85 €
AMERICAN LIBUS 0223	640 000	548 404,11 €
AMERICAN TOW 4.7%22	2 000 000	1 820 093,60 €
AMEXP 4200 1125	1 900 000	1 704 972,23 €
AMGEN 2.60%17- 2026	7 000 000	5 619 030,27 €
AMGEN INC 2% 02/26	3 000 000	3 157 080,27 €
AMGEN INC 3.875% 21	5 000 000	4 454 037,83 €
ANADARKO PE 5.55 326	1 300 000	1 209 239,38 €
ANALOG DEVICES	575 000	490 599,49 €
ANALOG DEVICES	6 800 000	5 777 817,24 €
AND LOG LP 4.25 1227	3 820 000	3 160 051,35 €
ANDE LOG LP 3.5 1222	1 066 000	906 476,37 €
ANDEA 6875 0223	1 775 000	1 405 923,24 €
ANG AMER 1.625 0925	850 000	807 512,32 €
ANGLO 4875 0525	3 810 000	3 292 319,33 €
ANGLO AME 4.75 27	1 800 000	1 522 259,11 €
ANHEU 3500 0124	9 180 000	7 930 021,53 €
ANHEU 4000 0428	13 860 000	11 649 345,93 €
ANHEUS 2.5% 07/22	75 000	63 206,71 €
ANHEUSER 2625 170123	385 000	323 860,78 €
ANHEUSER 3.30% 23	6 075 000	5 243 069,81 €
ANHEUSER 3650 0226	20 110 000	16 869 620,65 €
ANHEUSER-B 0.875% 22	9 500 000	9 647 941,60 €
ANHEUSER-B 2% 28	3 196 000	3 284 154,63 €
ANHEUSER-B 2.75% 36	4 896 000	5 022 613,50 €
ANNINGTON F 1.65 724	4 100 000	3 986 725,85 €
ANTER 5375 1121	3 560 000	3 026 434,26 €
ANTH 2500 1120	520 000	449 300,50 €
ANTHEM IN 4.101 0328	3 115 000	2 718 190,26 €

ANTHEM INC 3.65 1227	5 869 000	4 908 183,60 €
ANZ NZ 2.85% 15-2020	2 300 000	2 020 510,21 €
ANZ NZ INTL 0625 122	2 950 000	3 009 027,85 €
ANZ NZ INTL/LDN	6 700 000	6 709 047,91 €
ANZ NZL IN 0.12 23	2 210 000	2 178 937,88 €
AON 2.875% 14-2026	3 796 000	4 132 918,56 €
AON 4%13-2023	2 250 000	1 994 580,76 €
AON PLC 3.50% 24	1 000 000	855 073,45 €
APACHE CORP 4375 28	8 358 000	6 944 335,20 €
APPLE 2850 0223	12 695 000	11 066 762,46 €
APPLE 3250 0226	11 655 000	10 076 185,26 €
APPLE IN 2850 110524	4 220 000	3 612 062,57 €
APPLE INC	4 050 000	3 372 195,25 €
APPLE INC 0.87 25	6 471 000	6 550 710,19 €
APPLE INC 1.625% 26	14 000 000	14 655 821,74 €
APPLE INC 2.25 21	4 600 000	4 007 933,34 €
APPLE INC 2.5 090225	3 000 000	2 504 868,13 €
APPLE INC 2.75 0125	7 208 000	6 145 139,91 €
APPLE INC 2.85 21	790 000	693 887,31 €
APPLE INC 2450 0826	7 185 000	5 864 907,66 €
APPLE INC 3 24	3 500 000	3 052 438,44 €
APPLE L 0.35 110522	7 000 000	6 128 112,81 €
APPLIED M 3,3 010427	1 155 000	978 280,23 €
APRR SA 1.5 0133	3 300 000	3 249 035,98 €
APTIV 4250 0126	285 000	247 591,70 €
AQUARIUS 4.25%2043	10 452 000	11 516 105,24 €
ARCELOR 2.875% 2020	5 000 000	5 245 287,75 €
ARCELOR 3.125%2022	2 500 000	2 697 538,55 €
ARCHER-DANIELS	4 725 000	4 690 846,71 €
ARDAGH PKG FIN	2 000 000	1 679 167,21 €
ARES CAP 3.875% 20	4 010 000	3 576 897,32 €
ARGENTUM 1125 0925	2 500 000	2 519 900,92 €
ARGENTUM 2000 0930	4 200 000	4 298 063,73 €
ARION BANK 1 23	3 000 000	2 920 463,42 €
ARKEMA	1 000 000	1 000 801,64 €
ARKEMA 1.50%2025	2 800 000	2 898 884,72 €
AROUND 1625 310128	800 000	725 780,42 €
AROUND SA 2% 1126	2 100 000	2 000 251,18 €
AROUNDTOWN 1.50% 24	4 300 000	4 188 022,38 €
ASB FINA 0500 100622	9 170 000	9 147 443,78 €
ASHT CAPI 5.25 0826	1 500 000	1 295 126,41 €
ASHTEAD 4.125 150825	2 125 000	1 731 345,68 €
ASPA 3.875%16-2026	3 100 000	3 342 376,36 €
ASR NLD 5 PERP	2 000 000	2 082 277,40 €
ASSICU GEN 7.75%42	1 000 000	1 167 167,93 €
ASSICURA 4.125% 26	1 300 000	1 385 975,95 €
ASSICURA 8500 0349	1 800 000	1 901 348,63 €
ASSICURAZ 10.125% 42	1 900 000	2 438 996,97 €
ASSOCI 3500 0821	5 551 000	4 898 714,95 €
ASTRAZE 075 0524	2 000 000	1 988 525,63 €
ASTRAZEN 025 0521	2 400 000	2 400 916,17 €
AT AND T 2.45% 2020	385 000	332 533,09 €
AT AND T 3% 06 2022	6 275 000	5 353 140,66 €
AT AND T 4,3 150230	13 736 000	11 581 465,27 €
AT TIN 1799PCT 0926	15 278 000	15 137 856,78 €
AT& T INC 3.40% 25	2 000 000	1 658 230,91 €
AT& T INC 2.35 29	3 052 000	3 009 013,83 €
AT&T 1,45% 14-2022	3 000 000	3 091 008,97 €
AT&T 1.30% 2023	7 176 000	7 264 271,06 €
AT&T 2.40% 2024	4 200 000	4 490 291,85 €
AT&T 2.45% 2035	10 564 000	9 506 658,18 €
AT&T INC	2 000 000	1 920 049,74 €
AT&T INC 3.20 0322	1 480 000	1 289 896,67 €
AT&T INC 3.375% 34	1 100 000	1 131 256,87 €

AT&T INC 3.55% 32	4 520 000	4 718 939,33 €
AT&T INC 3.6% 23	2 024 000	1 780 089,54 €
AT&T INC 3.80 0324	4 165 000	3 645 473,61 €
AT&T INC 4.25 0327	33 390 000	28 979 849,68 €
ATF 1875 0126	4 800 000	4 658 037,99 €
ATF NETH 2125 130323	6 100 000	6 289 878,22 €
ATF NLD 3750 1299	3 100 000	3 082 561,96 €
ATHENE 4000 0122	5 160 000	4 635 335,93 €
ATLANTI 1625 030225	3 800 000	3 369 269,48 €
ATLANTI 1875 130727	1 000 000	843 698,36 €
ATLAS COPCO 2.625%19	2 610 000	2 678 339,81 €
ATOS SE 0750 070522	6 200 000	6 203 521,19 €
ATOS SE 1750 070525	10 100 000	10 178 379,81 €
ATR DU SUD 2.875%23	2 800 000	3 145 143,94 €
ATRIUM 3.625% 2022	1 580 000	1 675 410,79 €
ATRIUM EUROPEAN3 25	1 673 000	1 688 926,73 €
ATT LIB3M 0624	2 545 000	2 158 129,55 €
AUST 0625 0223	5 900 000	5 912 270,58 €
AUSTRAL PAC 3.125%23	1 316 000	1 474 937,30 €
AUT DUSUD 1.375 0628	7 700 000	7 725 630,48 €
AUTO SUD 2.95% 24	4 900 000	5 560 065,25 €
AUTONATIO 4.5 1025	2 000	1 698,17 €
AUTOROUTE 1250 0127	1 700 000	1 718 828,18 €
AUTOSTRAD 1.625% 23	4 800 000	4 492 496,16 €
AUTOSTRDE 1.75 26	3 000 000	2 525 412,70 €
AUTOSTRDE 1.875% 25	4 500 000	3 924 744,71 €
AVALONBAY 2.95% 26	2 325 000	1 926 615,49 €
AVALONBAY 4.20% 2018	3 200 000	2 881 889,52 €
AVIACAPIT 4.375 0124	3 650 000	3 199 304,37 €
AVIATION 2875 0122	8 700 000	7 452 306,38 €
AVIATIONCG 6.75 21	3 250 000	3 053 241,60 €
AVINOR AS 1.25 27	4 330 000	4 418 301,16 €
AVIVA PLC 1875 1127	6 840 000	6 811 870,25 €
AVIVA PLC 3.875% 44	2 724 000	2 795 330,51 €
AVNET 3750 1221	1 375 000	1 212 515,49 €
AXA 3.941%29/11/2049	3 343	3 472 171,64 €
AXA 4350 0428	4 000 000	3 342 941,29 €
AXA 5.125%13-2043	3 000 000	3 434 892,02 €
AXA SA 3.25 49	2 877 000	2 796 689,81 €
AXA SA 5.25%04-40	60	3 273 247,00 €
AXA VRN 10/99	1 700 000	1 737 963,21 €
B IRELAND 1.25% 2020	5 780 000	5 909 138,66 €
B IRELAND TF/TV 24	4 000 000	4 110 945,20 €
B OF NY ME 3.45 0823	2 870 000	2 551 169,69 €
BA AM LIM0 428	8 120 000	6 863 172,25 €
BA INTL LUX 1.5 0923	7 800 000	7 684 999,15 €
BABCOCK INTL 1.75%22	2 167 000	2 186 960,72 €
BAK HUG 3.337 27	9 250 000	7 424 505,65 €
BALD 1875 0126	1 050 000	1 003 844,84 €
BALL 4.375% 2023	6 000 000	6 627 190,28 €
BALT GAS ELEC 3.5 21	1 500 000	1 324 677,43 €
BALTIMORE 2.4 08/26	2 125 000	1 721 972,18 €
BAN OF AM 2.151 1120	6 250 000	5 375 041,01 €
BAN SABAD 5.375 1228	1 800 000	1 807 217,51 €
BAN SAN 2.125 0228	3 400 000	3 165 953,89 €
BANC SANT 3.125 0223	1 200 000	1 002 498,07 €
BANCO 0875 0323	1 900 000	1 821 170,84 €
BANCO 1125 0125	2 600 000	2 569 296,84 €
BANCO 6.05% 04/20	20	1 097 790,69 €
BANCO B 1375 140525	1 900 000	1 864 922,33 €
BANCO BLB V 0.75 22	400 000	394 441,11 €
BANCO SANTANDER	4 100 000	4 199 082,09 €
BANCO SDB 1625 24	3 000 000	2 914 834,88 €
BANCO STDER 3.848 23	7 200 000	6 167 618,95 €

BANCO STDER 3M112 23	7 800 000	6 740 783,22 €
BANK AMER 2.328 21	1 880 000	1 619 004,29 €
BANK AMER 3.666 26	5 575 000	4 747 150,42 €
BANK 7625 1026	1 860 000	1 984 001,36 €
BANK AME E3M 0523	1 350 000	1 327 626,68 €
BANK AMER 2.738 22	1 960 000	1 707 014,67 €
BANK AMER 4.45% 26	2 425 000	2 123 565,87 €
BANK E3M 0424	3 500 000	3 399 846,53 €
BANK IRL 1375 0823	1 050 000	1 019 152,94 €
BANK L3M 0724	2 305 000	1 975 051,96 €
BANK OF AM EI3M 0222	5 000 000	5 054 427,24 €
BANK OF AMER 3.3%30	14 185 000	12 408 529,83 €
BANK OF AMER 4.10%23	4 400 000	3 971 213,46 €
BANK OF AMER 5% 21	1 200	5 469 961,65 €
BANK OF AMER CRP	5 015 000	4 354 878,72 €
BANK OF AMER CRP	700 000	583 596,23 €
BANK OF AMER CRP	1 858 000	1 860 934,27 €
BANK OF MTRL 1.75 19	4 000 000	3 485 717,34 €
BANK OF NY MELLO	5 000 000	4 329 644,70 €
BANK OF NY MELLO	2 860 000	2 440 923,83 €
BANKIA 3375 150327	1 600 000	1 640 343,89 €
BANKIA SA TF/TV 24	6 700 000	6 868 887,73 €
BANKINTER 250 060427	800 000	799 704,11 €
BANQ FED 0500 161122	8 800 000	8 774 037,66 €
BARC LIBUS 160529	3 545 000	2 956 803,62 €
BARCL PLC 0.625 1123	5 050 000	4 794 804,64 €
BARCLAYS 1.875 0321	4 627 000	4 767 553,37 €
BARCLAYS 2.75% 2019	1 420 000	1 234 394,94 €
BARCLAYS 2000 0228	9 510 000	8 966 480,59 €
BARCLAYS 2650 0121	2 500 000	2 166 865,92 €
BARCLAYS 4610 150223	2 215 000	1 931 382,86 €
BARCLAYS 5.2 0526	1 935 000	1 639 975,20 €
BARCLAYS BK 5.14%20	9 315	8 341 489,77 €
BARCLAYS BK 6.625%22	2 000	2 343 053,82 €
BARCLAYS PLC 1.5 23	2 300 000	2 248 078,65 €
BARCLS PLC 1375 0126	5 361 000	5 025 311,89 €
BASF SE 0.875 25	3 906 000	3 925 661,27 €
BASF SE 1.625 1137	7 000 000	6 607 661,25 €
BAYER 4375 1228	2 250 000	1 886 204,24 €
BAYER AG 2.375% 75	5 719 000	5 449 071,03 €
BAYER CAP 0.625 22	2 200 000	2 191 397,21 €
BAYER CAP 1.5 26	2 000 000	1 958 235,63 €
BB&T CO 2050 150521	6 725 000	5 737 196,28 €
BB&T CORP 2.15 0221	1 845 000	1 592 314,61 €
BB&T CORPOR 2.45% 20	16 590 000	14 568 597,91 €
BBT CORP 5.25 19	6 721 000	6 033 006,11 €
BBVA Eurib3 03/23	1 000 000	959 390,00 €
BBVA SUB 3.5% 24	10 300 000	10 625 199,22 €
BC SAN ER+0.75 0323	3 700 000	3 586 459,95 €
BCO BILBAO 7 311299	4 600 000	4 613 431,00 €
BCO SAN 6.25% 2019	4 000 000	3 800 103,33 €
BCPE EUR3M 0323	3 000 000	2 897 828,33 €
BECT 1401 0523	2 455 000	2 490 641,49 €
BECT 3363 0624	3 335 000	2 803 781,31 €
BECTN 2133 0619	2 735 000	2 385 931,92 €
BECTN 2894 0622	7 350 000	6 242 954,27 €
BECTON 0368 0619	11 895 000	11 931 604,99 €
BECTON DCK 3.70 27	5 025 000	4 170 884,07 €
BECTON DICK.2.675%19	240 000	208 182,13 €
BECTON DICKI 1 1222	3 438 000	3 444 073,05 €
BELFIU BK 0.625 0823	5 500 000	5 509 411,24 €
BELFIUS 0750 0922	7 300 000	7 263 595,76 €
BELFIUS 1000 1024	5 800 000	5 661 334,24 €
BELFIUS BK 3.125% 26	2 000 000	2 087 361,79 €

BELFIUS BK 3.625% 25	1 400 000	1 073 642,42 €
BELGACOM 2.375% 2024	2 400 000	2 637 165,28 €
BEN STABI 2.375 0228	3 500 000	3 497 363,49 €
BENI STAB 1625 1024	2 200 000	2 164 277,73 €
BERKSH HAT 1.125%27	11 169 000	11 100 134,42 €
BERKSHIR HAT 0.75%23	3 899 000	3 950 953,19 €
BERKSHIRE 1.7% 19	3 400 000	2 983 428,25 €
BERKSHIRE 2.20%16-21	6 000 000	5 208 765,25 €
BERKSHIRE 2.75%16-21	5 020 000	4 337 887,76 €
BERKSHIREH 1.30% 24	4 000 000	4 134 530,93 €
BERTELSMA 1.25 0925	2 400 000	2 401 595,08 €
BEVCO LUX SARL	6 372 000	6 381 868,49 €
BFCM 0.25 06/19	4 200 000	4 212 097,73 €
BFCM 0.75 170725	13 500 000	13 273 165,58 €
BFCM 1.25% 25	7 500 000	7 700 960,16 €
BFCM 1.625% 26	300 000	314 696,00 €
BFCM 1250 0527	2 000 000	2 011 210,28 €
BFCM 2.625% 21	3 000 000	3 228 176,62 €
BFCM 3% 13-2023	1 000 000	1 114 182,10 €
BFCM 3% 14-2024	11 700 000	12 536 253,22 €
BFCM 4.125% 2020	3 000 000	3 245 959,46 €
BFIFTH CIN 2.25 0621	3 900 000	3 331 751,08 €
BG ENERGY 1.25%11/22	6 325 000	6 535 905,88 €
BHARTI AIRTEL 0524	2 275 000	1 966 512,82 €
BIMBO 3.875% 24	3 525 000	3 033 987,94 €
BIOGEN INC 3.625% 22	3 100 000	2 743 926,43 €
BK AMER 3.093% 1025	4 025 000	3 355 607,92 €
BK AMER 4271 0729	1 080 000	958 241,70 €
BK AMERICA 3.875%25	5 550 000	4 878 655,18 €
BK F C M 2.2625 0327	600 000	612 755,67 €
BK NOVA 2800 210721	8 925 000	7 829 235,01 €
BK NY MELLON 2.60%20	4 460 000	3 907 400,17 €
BK OF AMER 2.375% 24	10 121 000	10 886 893,13 €
BK OF NY 4625 0926	2 375 000	1 887 934,67 €
BK OFAM CRP L3M 0329	2 565 000	2 210 799,95 €
BK POSTALE 2.75% 26	6 700 000	7 017 858,25 €
BKAMERICA 2.50% 2020	7 584 000	7 937 327,98 €
BKAMERICA 3.50 26	5 400 000	4 570 051,17 €
BKAMERICA 4% 01/25	5 200 000	4 512 802,55 €
BKAMERICA 5.49 19	3 400 000	3 036 429,17 €
BKAMERICA TF/TV 25	13 823 000	14 048 053,25 €
BKMO 3.803% 1232	3 325 000	2 710 090,97 €
BLACK 1400 0722	2 752 000	2 759 834,58 €
BLACK 4.25% 11/23	6 000 000	5 313 873,94 €
BLACK HILLS 3.15% 27	1 075 000	888 615,89 €
BLACK HILLS 4.35 33	900 000	795 613,44 €
BLUE 9750 1023	4 015 000	3 930 899,78 €
BMBG BOND 3%2021	2 800 000	2 819 180,00 €
BMW FI 0250 140122	3 000 000	2 977 448,90 €
BMW FI 0500 22/11/22	1 500 000	1 490 826,06 €
BMW FI NV 0.375 0723	500 000	490 761,95 €
BMW FIN 0.125% 20	4 550 000	4 556 457,29 €
BMW FIN 100 1124	2 300 000	2 284 373,25 €
BMW FIN NV 1 25	2 600 000	2 557 093,38 €
BMW FIN NV 1125 0128	3 200 000	3 121 369,75 €
BMW FINANCE 0.50% 20	968 000	977 645,85 €
BMW FINANCE 0125 21	1 650 000	1 638 122,08 €
BMW US CA 1.125% 21	4 500 000	4 611 014,30 €
BNP 1125 0626	11 498 000	11 023 229,35 €
BNP PAR 2.375 1130	4 400 000	4 391 377,82 €
BNP 0,5 010622	5 000 000	5 034 267,02 €
BNP 0.75% 16-2022	6 980 000	7 056 385,22 €
BNP 2,375%15-2025	3 100 000	3 192 560,17 €
BNP 2.375% 20/05/24	3 500 000	3 846 889,61 €

BNP 4400 0828	2 550 000	2 211 335,93 €
BNP E3M 0624	2 050 000	1 977 154,28 €
BNP PAR 2875 1026	2 460 000	2 548 217,59 €
BNP PARI 4250 151024	2 500 000	2 165 525,81 €
BNP PARIB 1.12 23	5 406 000	5 589 720,41 €
BNP PARIB 1.5 11/25	3 540 000	3 500 078,03 €
BNP PARIB 2.625% 27	3 800 000	3 941 458,20 €
BNP PARIBAS	10 550 000	10 396 099,61 €
BNP PARIBAS 2% 2019	4 200 000	4 284 084,58 €
BNP PARIBAS 2.25%27	950 000	951 822,81 €
BNP PARIBAS 2.875%26	1 500 000	1 581 500,40 €
BNP PARIBAS 3.8% 24	5 650 000	4 891 828,53 €
BNP PARIBAS FR 1,125	4 030 000	4 000 644,36 €
BNP PRBAS 1.125% 23	3 250 000	3 243 649,38 €
BNPP 4,875%PERP	6 000	6 188 566,85 €
BNPP 5% 15/01/2021	5 500	5 077 442,44 €
BNPP CA 4.032% 99	2 100 000	2 085 982,22 €
BNPP CRDIF 1 24	18 200 000	16 911 338,16 €
BNZ 2650 1122	4 826 000	4 076 006,57 €
BNZ INTL FUND/LN	2 726 000	2 381 252,75 €
BNZ INTL FUND/LN	6 603 000	6 525 048,80 €
BOA 3.95% 2025	3 000 000	2 567 195,91 €
BOA 3499 17/05/22	17 345 000	15 214 423,49 €
BOA 3824 0128	9 980 000	8 592 710,79 €
BOA 4.2% 24	7 645 000	6 737 127,69 €
BOA 4.25% 26	8 905 000	7 594 601,73 €
BOA 5.625% 2020	272	1 230 885,36 €
BOA CORP 1.375% 21	6 225 000	6 414 544,97 €
BOA TV 18-201223	3 581 000	3 039 048,64 €
BOREAL AG 1.75 1225	3 238 500	3 258 321,84 €
BOST PR LP 3.20 0125	1 435 000	1 215 388,86 €
BOSTON 4.125% 2023	1 162 000	1 038 335,58 €
BOSTON PP 3.85% 23	4 000 000	3 554 548,59 €
BOSTON PRO 3.65% 26	4 780 000	4 105 916,56 €
BOSTON PRO 3.8% 24	2 225 000	1 968 009,13 €
BOSTON PROP LP 4,5%	850 000	762 375,24 €
BOSTON S 3375 150522	5 160 000	4 498 992,78 €
BP 3.561ù 2021	11 600	10 275 691,60 €
BP CAP 1953 0325	11 786 000	12 543 690,08 €
BP CAPIT 1.526% 22	7 000 000	7 279 692,10 €
BP CAPITAL 1.573%27	4 000 000	4 074 708,72 €
BP CAPITAL 1.594 28	5 200 000	5 217 410,16 €
BP CAPITAL 2.213% 26	3 576 000	3 797 970,95 €
BP CAPITAL 3.017% 27	3 900 000	3 251 537,03 €
BP CAPMKTS 1.117 24	7 364 000	7 540 880,63 €
BP CAPMKTS 3.06 22	3 375 000	2 946 126,83 €
BPCE SA 3500 1027	4 025 000	3 218 892,85 €
BPCE 0,375% 05/10/23	5 000 000	4 928 870,29 €
BPCE 0.625% 20/04/20	2 200 000	2 225 552,14 €
BPCE 0.875 0124	6 100 000	6 025 993,38 €
BPCE 1,125 180123	8 200 000	8 315 313,91 €
BPCE 1.125%15-2022	4 000 000	4 104 905,75 €
BPCE 1.375 0326	3 200 000	3 162 129,83 €
BPCE 2.125% 2021	1 700 000	1 804 128,06 €
BPCE 2.65% 16-2021	7 500 000	6 503 225,74 €
BPCE 2.75% 11/2027	5 400 000	5 621 225,28 €
BPCE 2.875% 24	500 000	566 533,96 €
BPCE 2.875% 26	3 000 000	3 177 003,55 €
BPCE 3% 14-2024	400 000	453 767,29 €
BPCE 4.25% 02/2023	1 700 000	2 020 581,91 €
BPCE 4.625% 23	15 200 000	17 543 820,00 €
BPCE 4000 0923	4 600 000	3 993 722,02 €
BPCE 5.15% 14-2024	4 300 000	3 850 929,01 €
BPCE SA 0.625 260923	13 100 000	13 065 664,98 €

BPCE SA 08/07/2026	4 000 000	4 178 802,40 €
BPCM 1077 0625	9 100 000	9 092 426,14 €
BPCM 1637 0629	2 131 000	2 123 635,52 €
BPOST SA	3 600 000	3 504 057,83 €
BQETO 0625 0723	950 000	950 914,08 €
BRANDY 3950 1127	3 810 000	3 202 135,33 €
BRANDY OPE 3.95 23	3 000 000	2 654 196,74 €
BRCLYS PLC 3.684% 23	8 179 000	6 987 037,96 €
BRDCOM CRP 3625 0124	5 000 000	4 201 883,69 €
BRIGHTHOUSE FIN	1 400 000	909 790,11 €
BRIGHTHOUSE FIN2	18 085 000	13 359 004,29 €
BRISA CNCSS 2.375 27	2 300 000	2 380 077,49 €
BRISA CONCES 2% 23	4 100 000	4 319 046,71 €
BRIT SKY 2.625% 19	2 701 000	2 363 601,43 €
BRITISH SKY 1.50% 21	7 388 000	7 606 489,37 €
BRITISH TEL 0.625%21	5 370 000	5 421 568,45 €
BRIX OPER 4.125 0626	2 400 000	2 031 444,69 €
BRIXMOR 3850 010225	2 500 000	2 139 014,03 €
BRK 3.45% 2021	2 600	2 317 653,85 €
BROADCOM 2.375PCT 1	6 900 000	6 023 358,26 €
BROADCOM 2,2PCT 17-1	3 750 000	3 239 655,78 €
BROADCOM 3.875PCT 17	915 000	732 627,00 €
BROADCOM. 2.65PCT 17	1 140 000	936 449,11 €
BROOK 4000 0424	6 060 000	5 280 903,00 €
BROOKFIELD 4.25 626	8 150 000	7 033 316,48 €
BTEL 0875 0923	10 033 000	9 852 700,85 €
BTEL 2125 0928	5 296 000	5 209 748,81 €
BUND 0 07/10/22	15 000 000	15 257 638,50 €
BUND 0.5 15/08/27	8 000 000	8 283 506,46 €
BUNDERSREPUB DEUTSCH	9 460 000	13 758 849,80 €
BURLINGTON 3% 0425	1 600 000	1 371 881,79 €
BURLINGTON 305% 0922	3 675 000	3 229 769,68 €
BUZZI 2125 0423	1 000 000	1 013 214,90 €
C ST GOBA 0875 923	900 000	899 697,11 €
C SUISSE 3574 090123	1 675 000	1 454 750,04 €
CA ASSUR 4.25% 2025	13 200 000	13 610 512,29 €
CA ASSUR 4.5% 49	4 000 000	4 025 246,80 €
CA IMPER BK 3.5 0923	8 506 000	7 521 832,73 €
CA LONDON 2.375% 24	9 300 000	10 155 537,84 €
CA LONDON 3.125% 23	2 400 000	2 696 349,83 €
CAFBQ EU3M 0622	1 200 000	1 185 327,70 €
CAINARE MU 3375 0928	3 700 000	3 436 182,38 €
CAIXABANK	4 200 000	4 129 940,56 €
CAIXABANK 1,75% 2410	11 500 000	11 458 527,67 €
CAIXABANK 1.125 0524	9 000 000	8 867 084,06 €
CAIXABANK 1125 0123	800 000	791 618,88 €
CAIXABANK 2250 0430	11 600 000	10 702 361,16 €
CAIXABK 3500 150227	100 000	105 909,42 €
CALDN EU3M 0323	6 900 000	6 697 767,14 €
CALPINCORP 5.25 0626	2 325 000	1 865 382,93 €
CAMPBELL 415 0328	6 395 000	5 263 406,95 €
CANADIAN NTL 3.80%24	830 000	716 990,57 €
CAPGEMINI SE 1 24	4 000 000	3 936 911,96 €
CAPGEMINI SE 1.75 28	1 500 000	1 481 344,58 €
CAPITAL 2350 310120	1 375 000	1 199 385,74 €
CAPITAL FI 2.50 0520	1 500 000	1 299 595,42 €
CAPITAL ON 3.75 0327	5 975 000	4 912 891,03 €
CAPITAL ONE 2.95% 21	4 500 000	3 924 489,35 €
CAPITAL ONE 3.2% 25	1 875 000	1 547 870,29 €
CAPITAL ONE 8.8%2019	2 655	2 482 521,19 €
CAPITNE FI 3.45 0421	5 000 000	4 386 071,38 €
CARDINAL H 3.079 624	5 540 000	4 588 677,10 €
CARGILL INC 2.5% 23	961 000	1 056 751,06 €
CARLI COS 3.5 1224	2 250 000	1 888 494,51 €

CARLSB BR 2.625%2019	3 705 000	3 802 526,26 €
CARLSBERG 2.5% 24	8 100 000	8 826 021,58 €
CARLSBERG BRW 0.5 23	1 100 000	1 086 483,02 €
CARMILA 2.375% 23	2 200 000	2 282 484,44 €
CARMILA 2.375% 24	1 000 000	1 022 083,47 €
CARREFOUR 1.75% 040	1 800 000	1 793 522,98 €
CARREFOUR 3.875%21	590 000	653 313,60 €
CASINO 3.248%14-2024	4 600 000	4 345 281,11 €
CATERPILLAR F 2.5 20	2 745 000	2 383 231,55 €
CELAN 2125 0327	3 815 000	3 715 361,48 €
CELG 3.875% 15/08/25	1 000 000	857 843,83 €
CELGENE 3.55% 2022	3 400 000	2 986 665,21 €
CELGENE 3900 0228	13 245 000	11 069 980,55 €
CEMEX 2.75 12/24	2 100 000	1 959 591,67 €
CEMEX SAB 6125 0525	1 140 000	983 051,73 €
CENOVUS NRGY 4.25 27	1 775 000	1 419 065,77 €
CENTENE 4.75 25	1 100 000	937 876,33 €
CENTENE CORP	3 500 000	3 147 114,33 €
CENTERP 3600 011121	660 000	582 294,19 €
CEZ AS 0,875% 211122	5 350 000	5 369 236,04 €
CFCM NORD 2.125%26	2 000 000	1 947 277,53 €
CHAR 3250 0521	1 770 000	1 558 776,23 €
CHARL SCH 3.2 012028	7 000 000	5 935 162,59 €
CHART 4200 0328	5 400 000	4 469 838,60 €
CHARTER COMM OPT	4 830 000	4 350 992,78 €
CHEVRON CORP 2.35%22	3 000 000	2 542 584,09 €
CHEVRON PHIL 2.45 20	6 750 000	5 874 383,28 €
CHORUS LT TF 23	3 399 000	3 412 418,53 €
CHRTER C OT 4.908 25	20 078 000	17 851 326,41 €
CHUBB 2500 0338	1 110 000	1 113 951,52 €
CHUBB INA HL 1.55 28	10 419 000	10 452 876,94 €
CI D ST GO 1.375 627	15 800 000	15 379 441,29 €
CIE DE ST GOB 1% 325	1 600 000	1 582 050,72 €
CIE FINAN RI 1% 0626	9 928 000	9 934 450,47 €
CIGNA 3050 1027	3 525 000	2 822 615,90 €
CIMAREX EN 3.9% 0527	4 845 000	3 974 413,07 €
CINTAS CORP 3.7 0427	4 705 000	4 039 700,51 €
CINTAS CORP NO.2	1 145 000	990 711,82 €
CISCO SYSTEM 1.85%21	5 000 000	4 274 474,29 €
CISCO SYSTEMS	1 725 000	1 507 071,91 €
CIT GROUP 4.75 24	3 113 000	2 645 578,73 €
CIT GROUP IC 5.25 25	1 162 000	1 010 395,67 €
CITI 3668 0728	295 000	248 154,66 €
CITI FINAN 4.35 25	1 861 000	1 623 491,81 €
CITIBANK NA 3.4 0721	4 035 000	3 585 917,58 €
CITIGR IN 1.625 0328	4 100 000	4 059 253,05 €
CITIGR L3MUS 0923	1 800 000	1 571 949,96 €
CITIGRO 3887 100128	9 340 000	8 013 854,76 €
CITIGRO E3M 0726	6 225 000	6 191 359,04 €
CITIGROU 3700 120126	2 000 000	1 711 997,55 €
CITIGROU 4075 230429	11 265 000	9 645 571,73 €
CITIGROU I 2.65 1020	9 500 000	8 234 845,36 €
CITIGROUP 0 07/28	335 000	279 837,51 €
CITIGROUP 0.75% 2023	7 111 000	6 987 803,41 €
CITIGROUP 1.375% 21	8 190 000	8 424 734,77 €
CITIGROUP 1.75% 2025	4 757 000	4 920 973,17 €
CITIGROUP 2.125% 26	7 650 000	7 975 947,42 €
CITIGROUP 2350 0821	6 000 000	5 144 138,27 €
CITIGROUP 3.375%2023	7 500 000	6 533 574,99 €
CITIGROUP 3.4% 26	5 225 000	4 324 551,05 €
CITIGROUP 5.50% 25	4 095 000	3 800 311,73 €
CITIGROUP 8.5%09-19	5 000	4 501 730,11 €
CITIGROUP I 4.6 0326	5 000 000	4 363 629,74 €
CITIGROUP TV250422	7 140 000	6 190 861,24 €



CITIGRP 4.4% 25	4 060 000	3 497 964,84 €
CITIGRP 4.45% 27	6 570 000	5 598 304,64 €
CITIZENS 2250 020320	7 300 000	6 363 082,05 €
CITIZENS 2250 1020	3 775 000	3 240 517,92 €
CITIZENS 2550 130521	4 419 000	3 793 624,11 €
CITIZENS BANK 2.5%19	2 000 000	1 761 062,76 €
CITIZENS F G 6 23	2 700 000	2 265 057,08 €
CITY NATIONAL	2 300	2 104 596,07 €
CITYCON TRES 2375 27	5 000 000	4 674 441,78 €
CLOVERIE 1.75% 2024	10 569 000	11 063 549,16 €
CLOVERIE PL 1.5 1228	8 722 000	8 569 620,63 €
CM ARKEA 1.25 0524	5 200 000	5 122 638,07 €
CNA 3.95% 05/2024	3 500 000	3 030 598,20 €
CNH 4875 0421	3 000 000	2 679 302,80 €
CNH CAPITA 4.37 22	4 873 000	4 330 579,85 €
CNH I FIN 1.375 0522	2 200 000	2 231 874,98 €
CNH IND 4200 0124	1 510 000	1 328 462,73 €
CNH IND CP 4.375% 20	2 000 000	1 771 118,55 €
CNP 4.25% 2045	100 000	107 145,49 €
CNP ASSU 4% 99	2 600 000	2 640 961,43 €
CNP ASSUR 1.875 1022	4 400 000	4 483 723,82 €
COCA-COLA 0 090321	1 400 000	1 399 094,90 €
COCACOLA 0.75% 2023	6 430 000	6 550 356,64 €
COCA-COLA 1.125% 27	10 302 000	10 418 608,08 €
COCA-COLA 3.8% 11/25	3 495 000	3 027 138,42 €
COCAEURO Eurib3 21	3 400 000	3 374 602,00 €
COFIROUTE 0375 0225	1 200 000	1 158 514,93 €
COLUMBIA PIPELIN	9 716 000	8 529 409,65 €
COM BK AU 1.936 1029	3 841 000	3 659 705,88 €
COMBK 100 0823	8 591 000	8 484 928,01 €
COMC 3950 1025	9 721 000	8 670 670,73 €
COMCAST 3.15 150228	1 900 000	1 577 416,35 €
COMCAST 3.15 26	3 420 000	2 887 546,25 €
COMCAST 3.375% 2025	2 480 000	2 148 980,80 €
COMCAST 5.15% 2020	4 000 000	3 641 631,55 €
COMCAST 9.455% 02-22	651	699 329,79 €
COMCAST COR 345 1021	5 595 000	4 979 108,69 €
COMCAST COR 370 0424	9 685 000	8 576 703,93 €
COMCAST COR 415 1028	12 510 000	11 195 412,50 €
COMCAST CORP	6 210 000	5 354 602,81 €
COMCAST CORP 5.7%19	2 210	1 958 303,14 €
COMCT 4700 1048	4 500 000	4 017 499,89 €
COMERICA 3700 310723	6 077 000	5 384 988,04 €
COMMER AG 8.125 0923	1 900 000	1 868 058,63 €
COMMERZ 1.125 0925	2 000 000	1 910 492,65 €
COMMERZB 4% 0326	12 527 000	13 357 056,13 €
COMMERZBANK 125 1023	8 900 000	8 810 094,46 €
COMMERZBK 0.50% 2023	5 489 000	5 272 669,99 €
COMMERZBK 05 061221	3 500 000	3 504 833,36 €
COMMONW BK 2.55%2021	7 470 000	6 477 528,67 €
COMMS 5000 0621	1 500 000	1 303 503,48 €
COMPASS 3500 110621	4 150 000	3 621 748,14 €
COMPASS GR 1.5 28	1 000 000	1 001 495,51 €
COMPASS GRP 1.875%23	3 650 000	3 904 521,52 €
COMPASS GRP 3.125%19	5 607 000	5 782 890,05 €
COMZBK AG 7.75 21	32	3 834 021,85 €
CON /MIDLA3.75 1027	4 075 000	3 387 806,80 €
CONCHO 4300 150828	2 250 000	1 967 417,88 €
CONCHO R 4375 150125	4 040 000	3 547 724,22 €
CONOG 4850 1128	4 525 000	3 917 293,78 €
CONS EDI 2000 150320	970 000	840 895,77 €
CONSTE BR 4.4 1125	3 175 000	2 810 720,64 €
CONSTE 4250 0523	2 165 000	1 923 944,67 €
CONSTELLATION BR	455 000	385 648,47 €

CONT 4375 0128	2 340 000	1 972 642,96 €
CONT AIRLN 4% 26 A	7 230 000	4 754 193,35 €
CONT AIRLN 7.25% 21	605	323 644,60 €
CONTIN 0000 050220	2 703 000	2 702 013,13 €
CONTIN RESO 3.8% 24	3 555 000	2 945 622,27 €
CONTINE 4500 150423	9 235 000	8 019 904,57 €
COOP 3125 0421	1 665 000	1 458 680,65 €
COVENTRY 5.45%11-21	4 225	3 834 321,94 €
COVENTRY BG 2.5%20	300 000	311 342,13 €
COVIVIO HO1.875 0925	2 600 000	2 528 131,73 €
CPI 4375 0823	1 500 000	1 403 163,70 €
CPI PROP 2125 1024	4 200 000	4 068 746,41 €
CPIP 1450 0422	6 624 000	6 533 576,64 €
CR AGRICOLE 3.875%19	5 100 000	5 299 141,03 €
CR LOG 1350 1129	2 000 000	1 895 639,41 €
CR MU ARK 1.875 1029	6 900 000	6 405 650,81 €
CR SUISSE 1.375% 19	4 620 000	4 687 306,44 €
CR. AGRI.ASSU TV48	3 800 000	3 995 713,02 €
CRDAG ASR 2625 0148	2 700 000	2 410 519,87 €
CRDT SUISSE 4.375%20	2 500 000	2 260 499,74 €
CRE SUISSE 1,5% 2026	5 400 000	5 620 507,91 €
CREAGR 0.875% 2022	6 500 000	6 650 224,35 €
CRED 3750 0423	4 000 000	3 433 311,46 €
CRED AGRI 3.875% 24	2 427 000	2 130 269,36 €
CRED SUIS 3800 0623	3 250 000	2 796 702,34 €
CRED SUIS GP 1.25%22	3 261 000	3 313 563,07 €
CRED SUIS NY 3.62%24	2 725 000	2 360 162,91 €
CREDI AGRI 2.625% 27	4 000 000	4 148 650,80 €
CREDIT AG 1.875 1226	4 000 000	4 023 597,11 €
CREDIT AGR 1.375 25	1 900 000	1 900 705,25 €
CREDIT AGR 1625 0329	3 900 000	3 898 514,17 €
CREDIT AGRICOLE	18 300 000	18 310 630,29 €
CREDIT SUIS 1% 2023	7 457 000	7 595 317,85 €
CRH FINANCE 3.125%23	5 155 000	5 802 556,26 €
CRITERI S 1.625 22	15	1 522 335,87 €
CRITERIA CXA 1.5 23	2 800 000	2 784 500,94 €
CROWN 3800 0228	3 890 000	3 246 912,77 €
CROWN CASTL 3.222%22	2 000 000	1 728 541,31 €
CROWN CASTL 3.4 0221	7 500 000	6 637 536,63 €
CROWN CASTL 4.241 28	3 545 000	3 078 350,98 €
CROWN CASTLE 5.25%23	2 021 000	1 880 379,49 €
CRWCASTINT 4 0327	4 395 000	3 760 309,78 €
CS GR FDG 3.45% 21	10 500 000	9 222 966,15 €
CS GR FDG 3.80 22	5 825 000	5 126 346,50 €
CS LONDON 1.375%22	20 227 000	21 059 547,49 €
CSAG 1250 0725	1 000 000	982 025,22 €
CSC HOLDIN 5.5 0427	2 325 000	1 925 890,08 €
CSNY 3% 29/10/21	4 000 000	3 460 100,01 €
CSTEL BRD 4.75 25	4 000 000	3 568 358,39 €
CSX CORP 3400 010824	1 080 000	952 935,31 €
CSX CORP 4.25 0329	445 000	397 113,96 €
CTE CO TRANSP EL	5 100 000	5 004 445,13 €
CTEFR 0875 0924	9 800 000	9 746 778,85 €
CTEFR 2125 0732	4 300 000	4 264 473,10 €
CUBESMAR L 3.125 926	975 000	810 278,41 €
CVS 3700 0323	19 025 000	16 671 513,00 €
CVS 4300 0328	24 380 000	21 133 077,41 €
CVS 5050 0348	3 210 000	2 771 742,89 €
CVS 4% 05/12/23	1 260 000	1 105 304,99 €
CVS CARRK 2.75% 22	1 390 000	1 169 251,79 €
CVS HEALTH 2.125 621	355 000	300 564,15 €
CVS HEALTH 3.50% 22	1 365 000	1 203 916,77 €
CVS HEALTH 3.875% 25	2 115 000	1 829 790,25 €
CVS HEALTH 4.1 25	17 568 000	15 378 836,66 €

CYRUSONE 500 0324	2 250 000	1 955 609,50 €
D S SMITH 1.37 24	5 580 000	5 406 371,99 €
D.R. 2250 1220	4 960 000	4 235 217,66 €
DAIM 0875 0424	1 700 000	1 682 399,34 €
DAIMLER 0250 110522	9 160 000	9 050 390,41 €
DAIMLER 1000 1125	4 500 000	4 382 221,30 €
DAIMLER 2.3 120221	5 150 000	4 430 889,13 €
DAIMLER AG 0.85 25	500 000	490 094,05 €
DAIMLER AG 0.875%21	11 300 000	11 534 707,19 €
DAIMLER BZ 0.50 19	19 334 000	19 435 484,96 €
DAIMLER BZ 2.25% 22	3 000 000	3 217 580,04 €
DAIMLER E3M 0522	3 400 000	3 341 690,00 €
DAIMLER FI 2.25 19	3 000 000	2 632 758,17 €
DANFOSS 1.375% 2022	3 577 000	3 697 819,50 €
DANO PERP 1750 0623	4 600 000	4 353 331,31 €
DANONE 1.125 25	3 500 000	3 554 841,01 €
DANONE 1.208% 2028	2 000 000	1 941 792,50 €
DANONE 1.691%16-2019	3 575 000	3 090 825,41 €
DANSKE BK AS 70 1299	1 225 000	969 028,00 €
DARDEN 3850 0527	10 975 000	9 295 465,03 €
DBAHN 1375 0331	5 503 000	5 584 191,87 €
DBOER 1125 0328	4 100 000	4 191 613,69 €
DBR 2.50% 2044	2 280 000	3 187 998,94 €
DE VOLKS0,125 280920	8 503 000	8 499 915,05 €
DE VOLKSBK 0075 0623	5 900 000	5 940 501,76 €
DELAIR LI 3.625 0325	3 150 000	2 715 657,39 €
DELL 6020 0626	2 000 000	1 766 487,34 €
DELT AIR L 2.875 320	1 055 000	923 160,50 €
DELTA 2600 1220	645 000	553 106,30 €
DELTA 3800 190423	3 135 000	2 699 396,70 €
DELTA LL 4.375% 49	3 243 000	3 334 443,05 €
DELTA LLOYD 9% 42	1 483 000	1 883 758,61 €
DEMETER INV 4.375%25	2 195 000	2 310 989,21 €
DEMETER INVT.3.5% 46	1 249 000	1 298 419,81 €
DESJA 0250 0921	3 850 000	3 845 929,91 €
DEU TELE Eurib3 22	1 750 000	1 739 078,74 €
DEU.BK .4.875%1232	885 000	605 261,60 €
DEUT 1375 1225	4 500 000	4 568 552,78 €
DEUT 1000 1227	1 500 000	1 443 732,96 €
DEUT 2700 0720	4 200 000	3 613 326,33 €
DEUT 3150 0121	8 475 000	7 260 613,27 €
DEUT BAHN 0.875%31	4 782 000	4 534 623,21 €
DEUT BK 1125 0823	2 400 000	2 395 289,91 €
DEUT BK NY 425 0221	2 390 000	2 079 208,94 €
DEUT E3M 1220	5 400 000	5 249 653,20 €
DEUT TEL FI 0.625%23	6 000 000	6 027 022,82 €
DEUT TEL FIN 1.5% 28	950 000	949 845,22 €
DEUTANNIG TF/TV 74	9 500 000	9 883 727,12 €
DEUTK 5851 0323	1 100 000	1 379 859,80 €
DEUTSC ANN 2.125%22	2 500 000	2 623 662,29 €
DEUTSC NY 4.25 21	125 000	108 539,61 €
DEUTSCHE 0375 0121	3 000 000	2 918 558,21 €
DEUTSCHE 1600 1228	2 350 000	2 368 567,58 €
DEUTSCHE 4% 31/12/99	8 200 000	8 436 143,72 €
DEUTSCHE B 1.5 0122	8 900 000	8 854 889,19 €
DEUTSCHE W 1.375% 20	5 764 000	5 889 610,88 €
DEUTSCHLAND 050 0226	7 390 000	7 713 375,01 €
DEVON ENGY 3.25% 22	559 000	478 086,85 €
DH EUROP FN 170 0122	1 723 000	1 820 013,04 €
DH EUROPE 1% 07/19	2 330 000	2 347 973,88 €
DH EUROPE 1200 0627	3 780 000	3 730 353,65 €
DIAGE 1500 1027	2 240 000	2 270 847,04 €
DIAGEO 1000 0425	2 720 000	2 726 300,61 €
DIAGEO CAP LIB24 20	2 525 000	2 208 389,32 €

DIAGEO FIN 1.125% 19	3 950 000	3 991 109,22 €
DIAGEO FIN 1.75% 24	1 900 000	1 998 516,16 €
DIAGEO FIN PLC	750 000	751 064,10 €
DIAMOND FIN 3.48%19	5 309 000	4 646 615,38 €
DIAMOND1 2. 4.42%21	12 095 000	10 597 025,02 €
DIAMOND1 TF 5.45%23	12 400 000	11 022 240,30 €
DIGITAL 3950 0722	5 274 000	4 624 545,50 €
DIGITAL REALTY 3.5 1	6 878 000	5 779 669,97 €
DIGITAL RLTY 2.75 23	410 000	345 814,95 €
DISCO 2950 0323	4 240 000	3 585 798,87 €
DISCO 2200 0919	170 000	148 291,70 €
DISCOV 3350 0223	1 000 000	861 154,85 €
DISCOV BK 3.20 0821	445 000	389 637,27 €
DISCOV FIN 3.95% 24	2 650 000	2 295 656,34 €
DISCOVER 4.10 0227	940 000	778 551,72 €
DISCOVER 4682 0828	1 125 000	980 843,72 €
DISCOVER BK 8.7%19	506	467 594,64 €
DISCOVERY 380 130324	1 975 000	1 708 040,45 €
DISCOVERY 4.90%16-26	440 000	392 531,83 €
DISCOVERY 5.625%19	1 491	1 349 761,61 €
DKE BANK 0250 1122	5 684 000	5 547 907,85 €
DNB 1125 0328	9 700 000	9 601 994,43 €
DNB BANK A 2.125 20	4 000 000	3 444 977,57 €
DNB BANK ASA	3 500 000	3 529 028,46 €
DNB BK 1125 0323	5 000 000	5 175 818,76 €
DOLLAR GL 3.25% 2023	3 390 000	2 920 805,10 €
DOLLAR TREE 4 25	5 675 000	4 794 092,12 €
DOLLAR TREE 4.2 28	8 535 000	7 111 342,73 €
DOMINION 1.6%16-2019	1 125 000	979 077,55 €
DOW 4205 1123	1 550 000	1 390 584,09 €
DOW 4493 1125	7 730 000	6 972 236,13 €
DOW CHEMI 3.5% 1024	2 645 000	2 250 279,05 €
DOW CHEMICAL 4,55% 3	7 300 000	6 493 023,74 €
DQUSN LGHT 3.616 27	4 000 000	3 349 228,20 €
DREAM GLBAL 1.375 21	5 000 000	4 964 448,63 €
DT PFAND 2875 280627	2 700 000	2 638 512,86 €
DT PFANDBRIEFBAN	5 600 000	5 577 137,07 €
DUKE REALTY	2 000 000	1 738 920,24 €
DUKE REALTY 4 28	3 187 000	2 797 513,40 €
DUPONT E 2200 010520	3 025 000	2 629 258,31 €
DVB BANK 1250 220420	2 200 000	2 236 423,25 €
DXC TECHCO 1.75 0126	3 369 000	3 173 678,43 €
E.ETAT 3.75%05 OAT	702 198 690	789 495 224,32 €
E.ETAT 8.5%92 OAT	723 400 593	1 037 604 510,21 €
E.ON SE 0.375 0821	4 482 000	4 499 085,55 €
EASTMAN CHEMI 3.6%22	2 431 000	2 151 673,71 €
EASTMN CHM 2.70 20	1 304 000	1 146 958,77 €
EATON 2.75%2022	2 200 000	1 879 318,89 €
EBAY INC 2150 050620	1 525 000	1 318 307,87 €
EBAY INC 2200 010819	2 000 000	1 752 523,97 €
ECOLAB 2.625% 2025	2 966 000	3 250 295,51 €
EDENRED 1.875 0326	7 800 000	7 746 635,17 €
EDENRED 1875 0327	2 000 000	2 002 802,38 €
EDF 4000 1024	7 400 000	7 235 147,26 €
EDF 1% 13/10/2026	7 000 000	6 791 189,13 €
EDF 1,625% 271125	4 300 000	4 461 980,83 €
EDF 1.875% 36	600 000	547 129,22 €
EDF 2000 021030	3 700 000	3 646 498,71 €
EDF 4.50 21/09/28	3 625 000	3 109 258,41 €
EDF 5 5/8%33	1 188	1 713 977,06 €
EDF 5% 14-2049	3 000 000	3 055 241,88 €
EDF 5.375% 2049	3 100 000	3 317 840,82 €
EDISON INC 2% 0521	2 700 000	2 294 336,70 €
EDP FIN 1.125% 2024	3 400 000	3 389 012,30 €

EDP FINA BV 1.5 1127	2 830 000	2 661 828,74 €
EDP FINANCE BV	1 700 000	1 713 042,74 €
EDP FINANCE BV	2 500 000	2 461 098,31 €
EDP SA 2375 160975	3 400 000	3 706 398,68 €
EL PASO 6.5% 2020	2 525 000	2 354 104,45 €
EL PASO OP 6.50% 20	3 328 000	3 065 320,79 €
ELI LILLY 2.125% 30	2 500 000	2 693 843,01 €
ELM BV 3375 290947	3 600 000	3 546 456,16 €
ELY LILLY 1.625% 26	1 800 000	1 899 641,91 €
EMBRAER NL 5.05% 25	3 250 000	2 879 198,92 €
ENABLE MIDS 4.4 0327	3 415 000	2 779 528,89 €
ENABMIDST 4.95 0528	1 650 000	1 383 985,04 €
ENAGAS FIN 1.25% 25	2 000 000	2 068 854,03 €
ENBRIE INC 2.9 07/22	355 000	303 872,83 €
ENBW 1875 311033	1 926 000	1 932 176,43 €
ENCANA C 3.9 1121	3 000 000	2 629 208,77 €
ENEL 2875 0522	5 300 000	4 383 283,93 €
ENEL 3625 0527	2 425 000	1 863 857,75 €
ENEL 1125 0926	16 600 000	15 732 375,92 €
ENEL 4875 0628	1 325 000	1 152 985,58 €
ENEL FIN 1.966% 2025	3 208 000	3 340 814,37 €
ENEL FIN I 4.875 29	3 250 000	2 700 196,37 €
ENEL SPA 2500 1178	2 600 000	2 398 135,29 €
ENERGIE B 3.375 0477	2 341 000	2 451 092,90 €
ENERGY TRAN 4.15%20	2 000 000	1 771 938,16 €
ENEXIS HOLD 0.875%26	2 600 000	2 588 006,85 €
ENEXIS HOLDG 1,50%23	4 290 000	4 484 409,47 €
ENGIE	19 400 000	17 934 472,84 €
ENGIE 1875 0933	3 800 000	3 823 960,92 €
ENGIE 2000 0937	2 300 000	2 317 815,27 €
ENI 0.625% 16-2024	4 500 000	4 359 836,56 €
ENI 4.25%12-03/02/20	2 399 000	2 600 927,45 €
ENI SPA 0.75% 22	2 536 000	2 566 343,43 €
ENI SPA 1.125% 2028	6 400 000	5 958 185,11 €
ENI SPA 1.50% 26	400 000	403 493,29 €
ENI SPA 2.625% 2021	3 004 000	3 211 891,66 €
ENI SPA 4.125%09-19	43	2 238 447,76 €
ENTER PR L3M 0278	3 026 000	2 223 471,84 €
ENTER PRODU 5.20% 20	5 000	4 573 731,45 €
ENTERGY 5.59% 24	1 000 000	975 931,03 €
ENTERGY 4% 15-2022	5 605 000	5 018 080,36 €
ENTERGY AR 3.5 04/26	1 620 000	1 408 229,37 €
ENTERGY CO 2.95 0926	475 000	386 630,52 €
ENTERGY MISS 2.85 28	1 125 000	910 405,46 €
ENTERP PROD 3.75% 25	1 350 000	1 180 150,24 €
ENTERPR 4150 161028	1 730 000	1 518 148,63 €
ENTERPRISE 5.25%2020	5 230	4 761 752,25 €
ENTERPRISE O 6.5 119	1 378 000	1 241 369,28 €
ENTERPRISE PRODU	2 700 000	2 430 212,57 €
EP INFRASTRUCTUR	3 272 000	3 041 795,23 €
EQUIFAX 3300 1222	7 930 000	6 740 378,60 €
ERAC USA 3.85% 2024	2 300 000	2 015 934,63 €
ERAC USA FINANCE	5 980 000	5 079 409,39 €
ERICSS LM 0.875 0321	2 700 000	2 718 909,62 €
ERP OPERA 2.85 11/26	2 450 000	2 015 933,97 €
ERP OPERATING 4,15%	3 750 000	3 350 131,77 €
ERSTE GRP 1.875% 19	2 300 000	2 343 451,41 €
ERSTE GRP 7.125%2022	5 500 000	6 766 061,87 €
ESB FINAN 1.75 0229	4 861 000	4 977 005,91 €
ESB FINAN 3.494% 24	728 000	848 118,88 €
ESSEX 3250 0523	3 000 000	2 581 359,99 €
ESSEX PORT 3.62 22	2 000 000	1 771 571,25 €
ESSILOR 1,75% 090421	2 500 000	2 618 306,90 €
ETP 9% 15/04/2019	1 222	1 106 144,37 €

EURO INVS 2.625 0448	1 700 000	1 685 672,49 €
EUROC INVS 1.5 0430	4 500 000	4 525 931,71 €
EUROCLEAR 1.125 -26	5 400 000	5 425 480,39 €
EUROCLEAR BK 0.5 23	600 000	599 634,39 €
EUROCLEARB 0 22	2 150 000	2 141 815,21 €
EUROGRID 3.875% 2020	38	2 043 583,95 €
EURONEXT NV 1% 0425	4 901 000	4 954 384,08 €
EUTELSAT 1.125% 21	2 300 000	2 326 727,96 €
EUTELSAT 2000 021025	9 200 000	8 794 729,79 €
EVONIK 2125 071122	1 100 000	1 058 583,34 €
EVONIK FIN 0.75 0928	2 250 000	2 039 813,91 €
EXELON 2.85% 20	1 100 000	954 271,53 €
EXELON 3497 0622	1 295 000	1 107 978,55 €
EXELON 4% 10-2020	1 850	1 639 458,17 €
EXELON COR 3.95 25	4 175 000	3 609 988,09 €
EXELON CORP 2.45% 21	105 000	90 265,95 €
EXOR SPA 2.125% 22	1 500 000	1 566 753,17 €
EXOR SPA 2.5%10/24	2 500 000	2 607 949,76 €
EXPEDIA 2.50% 22	5 100 000	5 342 342,48 €
EXPEDIA 5.95 20	3 700 000	3 417 271,43 €
EXPEDIA 5000 150226	360 000	323 484,06 €
EXPEDIA INC 3.8 28	2 545 000	2 054 715,80 €
EXPRESS 3500 0624	3 350 000	2 851 844,46 €
EXPRESS SCRPT 4.5%26	1 750 000	1 573 553,34 €
EXXON 2.222% 16-2021	9 025 000	7 833 036,13 €
EXXON MOBI3.043 0326	2 700 000	2 327 275,03 €
FAURECIA 2625 0625	5 150 000	4 875 054,38 €
FAURECIA 3625 0623	2 850 000	2 862 490,13 €
FCA BANK IE 1%1121	8 000 000	7 916 874,12 €
FCA BK I Eurib3 21	5 052 000	4 885 228,29 €
FCA BK IRL 0.25 20	3 550 000	3 497 420,93 €
FCA BK IRL 1 22	3 869 000	3 824 079,04 €
FCA CAP IRE 1.25% 20	2 473 000	2 493 478,54 €
FCA CAPI 1.375% 20	7 073 000	7 197 274,67 €
FCA CAPI 1250 210121	3 883 000	3 929 302,30 €
FCC AQ 1413 0622	1 449 000	1 457 802,64 €
FCC AQUA 2.629 0627	2 070 000	2 073 856,26 €
FCE BANK 1.875% 21	5 421 000	5 453 156,74 €
FCE BANK 0869 0921	6 018 000	5 847 829,14 €
FCE BANK 1660 110221	1 500 000	1 521 951,75 €
FCE BANK PL 1615 523	1 500 000	1 447 778,91 €
FEDEX 3.25%16-2026	500 000	419 002,56 €
FERGUSON FIN 4,5% 24	3 000 000	2 620 299,17 €
FERR 2124 0523	500 000	427 533,44 €
FERROVIAL EMISIO	5 100 000	5 116 541,87 €
FERROVIE 1500 0625	2 000 000	1 851 776,64 €
FGA CAPITAL 2% 19	1 930 000	1 963 669,25 €
FIDELI NATIO 2.25%21	5 496 000	4 691 924,83 €
FIDELITY 3.625% 2020	2 510 000	2 222 000,84 €
FIDELITY 3.875% 2024	1 669 000	1 463 262,35 €
FIDELITY 4.50% 2022	644 000	585 134,97 €
FIDELITY NAT 4.25 28	290 000	253 686,68 €
FIDELITY NATL 3.5%23	817 000	713 279,15 €
FIFTH 2200 1020	4 981 000	4 288 370,20 €
FIRST AMERIC 4.60%14	2 900 000	2 587 950,55 €
FIRST DATA 5375 0823	3 155 000	2 768 733,41 €
FIRST HORIZ 3.5 1220	745 000	651 538,56 €
FISERV INC 1000 1023	10 500 000	9 318 279,90 €
FLA GAS 5.45%0720	1 000 000	922 462,78 €
FLYON 1500 0525	2 600 000	2 571 068,50 €
FO MOT CR 3.813 1021	5 455 000	4 685 908,94 €
FONCIERE REGIONS	5 300 000	4 978 786,58 €
FONTERRA 0750 081124	3 500 000	3 438 787,40 €
FOR MO CR E3M 1123	2 300 000	1 998 501,05 €

FORD 2979 0822	2 300 000	1 881 069,63 €
FORD 3815 1127	1 170 000	873 940,11 €
FORD M +127 280322	11 210 000	9 393 792,43 €
FORD M C LIB3M 23	2 155 000	1 754 316,50 €
FORD MOTO 4.134 25	1 210 000	970 170,06 €
FORD MOTOR 2.59 19	3 000 000	2 605 527,34 €
FORD MOTOR 3.33 22	1 770 000	1 474 638,07 €
FORD MOTOR 3096 0523	8 050 000	6 403 198,79 €
FORD MOTOR 4.25% 22	1 325 000	1 126 623,48 €
FORD MOTOR 4.389% 26	1 200 000	972 329,53 €
FORD MOTOR 5.875%21	905 000	830 307,61 €
FORT BRS H 4 0923	3 575 000	3 139 999,71 €
FORTIS INC 2.1 21	1 925 000	1 625 041,95 €
FORTIVE 2.35%17-2021	3 450 000	2 935 691,51 €
FORTIVE CP 3.15 0626	3 830 000	3 103 551,37 €
FRESENI FI 2.125 227	1 350 000	1 355 960,85 €
FRESNS 2875 0720	2 596 000	2 684 970,55 €
FRTEL 4.125% 2019	1 300 000	1 353 884,64 €
FS INVS CP 4.25 0120	2 450 000	2 186 329,15 €
FTB MEMPHI 2.95 19	7 825 000	6 815 291,42 €
G4S 1875 0525	4 353 000	4 308 944,81 €
GAI BOND IS 3.4 926	3 175 000	2 628 192,13 €
GALP GAS 1.375% 2023	3 900 000	3 881 232,63 €
GAS NAT 1875 1029	300 000	299 451,99 €
GAS NAT FENOSA F	2 500 000	2 427 876,79 €
GATX CORP 4,35% 1502	1 550 000	1 379 493,00 €
GCITP 1500 0227	2 200 000	2 029 158,79 €
GDF SUEZ 2.375% 2026	2 500 000	2 752 500,21 €
GDF SUEZ 3% 2049	11 900 000	12 191 326,67 €
GDYEAR DTE 3.75 23	1 000 000	996 785,00 €
GE CAP EUR FD 0.8%22	5 510 000	5 320 269,10 €
GE CAP IN 3.373 1125	3 155 000	2 463 936,83 €
GE CAPIT2.342% 20	8 000 000	6 775 892,35 €
GE EUR FUND 5.375%20	1 000	1 097 355,80 €
GECINA 1.375 06/27	2 700 000	2 655 456,27 €
GECINA 1.5% 2025	4 600 000	4 745 211,74 €
GECINA 1.625 30	3 600 000	3 452 147,50 €
GECINA 1375 0128	2 000 000	1 951 470,52 €
GECINA 2% 24	1 000 000	1 058 047,50 €
GELF BOND 1.75% 21	3 800 000	3 898 206,06 €
GELF BOND 0.875% 22	3 120 000	3 091 944,79 €
GEN 4150 0623	3 530 000	3 005 120,79 €
GEN 4350 0425	2 290 000	1 923 387,66 €
GEN ELEC 0.375 05/22	5 056 000	4 766 590,96 €
GEN ELECT 0.875 0525	14 545 000	13 137 954,09 €
GEN ELECT 1.875 % 27	6 000 000	5 578 898,22 €
GEN ELECT 2.125 0537	4 228 000	3 343 097,90 €
GEN ELECTR 1.5 05/29	1 763 000	1 541 254,18 €
GEN ELECTRI 1.25% 23	16 800 000	16 175 998,27 €
GEN ELECTRIC 2.7%22	3 325 000	2 710 319,29 €
GEN MILLS 3.20 21	255 000	223 361,05 €
GEN MILLS 4.20 28	215 000	185 636,82 €
GEN MOT 4200 010321	4 480 000	3 979 635,68 €
GEN MOT FIN L3M 0421	500 000	427 889,23 €
GEN MOTORS 3.2% 20	8 780 000	7 707 499,06 €
GEN MOTORS 3.10% 19	1 725 000	1 530 546,73 €
GEN MOTORS 3.2% 21	4 130 000	3 581 874,36 €
GEN MOTORS 3.55 21	2 165 000	1 883 498,55 €
GEN MOTORS 3.7 0523	5 635 000	4 723 363,82 €
GEN MOTORS 3950 0424	1 075 000	896 447,19 €
GEN MOTORS F 1 0520	3 664 000	3 729 853,07 €
GEN MOTORS FIN	435 000	357 721,84 €
GEN MOTORS FIN	2 210 000	1 841 951,82 €
GENERAL MIL 2.1% 20	300 000	309 806,56 €

GENERAL MILLS 3.7 23	435 000	381 072,06 €
GENERAL MILLS IN	7 887 000	6 872 273,23 €
GENERAL MTRS 4.2 27	1 980 000	1 587 210,08 €
GENMOTFIN 4.375% 21	4 365 000	3 877 351,52 €
GENMOTFIN 5.25%2026	6 606 000	5 787 909,28 €
GILEAD 2.35%02/20	1 650 000	1 447 063,96 €
GILEAD SCIE 2.5 0923	1 720 000	1 455 311,57 €
GILEAD SCIE 3.25% 22	455 000	400 540,06 €
GILEAD SCIE 3.5% 25	1 700 000	1 477 330,38 €
GILEAD SCIE 3.65% 26	8 160 000	7 084 844,75 €
GILEAD SCIENCES	3 000 000	2 649 168,24 €
GLAX 0000 0920	12 536 000	12 514 003,08 €
GLAXOS 1250 210526	9 026 000	9 120 001,04 €
GLAXOS 1750 210530	1 418 000	1 457 174,89 €
GLAXOSM 3.625 0525	7 000 000	6 184 991,76 €
GLD SACHS LIB117 26	2 705 000	2 258 256,40 €
GLEN F LC 3.875 1027	4 950 000	3 929 230,75 €
GLENCORE FI 3.375%20	3 000 000	3 158 319,74 €
GLP CAPITA 4.87 20	2 235 000	1 975 566,45 €
GLPFI 4375 0421	3 355 000	2 915 060,11 €
GOLD 2000 1128	2 294 000	2 216 479,44 €
GOLD L3M 0529	12 860 000	10 920 149,11 €
GOLD M L3US 06/28	5 985 000	4 880 044,75 €
GOLD SACHS 2.75% 20	2 350 000	2 047 500,33 €
GOLD SACHS 3.5% 25	3 840 000	3 226 505,48 €
GOLD SACHS 4.25% 25	7 930 000	6 696 328,83 €
GOLDCORP 3.70%13-23	1 700 000	1 488 234,26 €
GOLDM SA L3MUS 0623	12 070 000	10 119 750,04 €
GOLDM SACH 3.75 0226	755 000	633 557,60 €
GOLDMA 3000 260422	1 425 000	1 214 585,57 €
GOLDMA E3M 1220	1 000 000	994 775,64 €
GOLDMAN 2.875% 2026	800 000	857 178,45 €
GOLDMAN 1.625% 2026	1 300 000	1 267 237,77 €
GOLDMAN 2.625% 21	3 200 000	2 742 452,58 €
GOLDMAN 2300 131219	1 805 000	1 565 908,80 €
GOLDMAN 5.125% 10/19	22	1 155 285,55 €
GOLDMAN 5.75%12-2022	3 090 000	2 899 017,73 €
GOLDMAN S 1.375 0524	1 750 000	1 752 218,99 €
GOLDMAN SA 3.85 0127	11 845 000	9 954 507,11 €
GOLDMAN SACH 2.55%19	2 000 000	1 747 869,19 €
GOLDMAN SACHS 2% 23	6 556 000	6 802 404,79 €
GOLDMAN SACHS 4% 24	9 370 000	8 175 775,47 €
GOLDMAN SACHS GP	720 000	607 926,78 €
GROUPAMA E3M 1299	2 000 000	2 160 539,32 €
GRUPO TE 4625 300126	2 785 000	2 454 951,98 €
GSACHS G 2.60 20	5 500 000	4 785 649,79 €
GSACHS G 2.625% 2020	11 648 000	12 184 108,99 €
GSACHS G 3.25% 23	1 900 000	2 112 148,13 €
GSACHS G 3.50 26	1 000 000	812 919,95 €
GSACHS G Eurib3 23	1 000 000	953 340,28 €
GUARDIAN LIFE	6 253 000	5 335 518,33 €
HALF PAR 3.75 0723	2 225 000	1 962 826,37 €
HALF PAR 4.125 1125	9 000 000	7 971 440,76 €
HALFMOON 3200 0920	3 565 000	3 136 358,68 €
HALFMOON PARENT	2 250 000	2 003 225,18 €
HALLIBURT 3.8% 1125	2 795 000	2 380 735,76 €
HAMMERSON 2% 22	2 250 000	2 294 842,68 €
HANNOVER 3.375% 49	3 800 000	3 952 611,64 €
HARRIS C 4.40 28	2 695 000	2 359 689,81 €
HARRIS C 4854 270435	1 250 000	1 102 960,02 €
HASBRO 3.5% 09-2027	2 380 000	1 919 198,36 €
HCA INC 4.75%12-2023	2 900 000	2 508 768,41 €
HCA INC 5 0324	4 425 000	3 875 721,69 €
HCA INC 5250 150626	1 825 000	1 582 856,04 €



HDLBRG LUX 0.50 22	4 635 000	4 563 760,05 €
HEALT 3750 0727	2 815 000	2 356 528,77 €
HEALTH CARE 4.50%24	2 000 000	1 824 257,53 €
HEALTHCARE 3.5%26	2 990 000	2 498 343,66 €
HEATHROW 1.875% 2022	3 000 000	3 133 638,66 €
HEATHROW FNDG 1.5%30	700 000	663 471,45 €
HEIDEL 1750 240428	5 830 000	5 578 676,76 €
HEIDELCE 1.625 0426	8 035 000	7 969 120,79 €
HEINEKEN 1% 16-2026	13 900 000	13 762 648,98 €
HEINEKEN 1500 1029	2 900 000	2 856 629,40 €
HEINEKEN 2.125%2020	3 970 000	4 135 027,40 €
HEINEKEN NV 1.75 331	3 320 000	3 307 741,51 €
HEINEKEN NV 2% 21	3 700 000	3 910 716,15 €
HELLA FINANCE 1% 24	800 000	801 479,01 €
HEMSO FAST 1.75 0629	3 900 000	3 647 019,29 €
HERA SPA 0875% 26	600 000	557 443,07 €
HERA SPA 2.375% 24	200 000	213 090,59 €
HESS CORP 4300 0427	1 225 000	993 179,50 €
HIT FIN.4,875%1021	13	724 226,22 €
HIT SAS 0.625 23	3 900 000	3 780 225,80 €
HIT SAS 1.625 27	2 000 000	1 861 006,12 €
HLDG D'INFRA 2.25%25	1 500 000	1 539 962,24 €
HOCHTIEF 1750 030725	2 000 000	2 048 778,64 €
HOLCIM FIN. 2.25% 28	2 370 000	2 347 252,58 €
HOME 2800 0927	8 080 000	6 717 025,46 €
HOME DEP 3900 061228	4 425 000	3 966 977,76 €
HOST H&R 6% 10/21	775 000	721 227,16 €
HOST HOTELS 3.75%23	2 950 000	2 536 860,64 €
HP ENT 3500 1021	7 740 000	6 849 787,35 €
HP ENTERPR 2.10 1019	2 500 000	2 172 750,01 €
HP ENTERPR 3.6 10/20	4 380 000	3 871 825,74 €
HSBC 3.90 05/26	5 100 000	4 282 039,98 €
HSBC 4% 30/03/2022	2 000 000	1 787 557,77 €
HSBC 4292 0926	1 275 000	1 112 989,92 €
HSBC 5.1% 05/04/2021	5 000	4 566 708,95 €
HSBC FR 0200 0921	15 200 000	15 167 349,10 €
HSBC FRANCE	3 700 000	3 718 380,43 €
HSBC HG E3M05 1023	250 000	239 656,25 €
HSBC HLD 1500 041224	5 990 000	5 997 055,48 €
HSBC HLD 3.262% 0323	12 077 000	10 435 749,50 €
HSBC HLD E3M70 0922	9 673 000	9 482 014,68 €
HSBC HO 4,375 231126	690 000	586 985,06 €
HSBC HOL 0875 060924	15 425 000	14 943 873,27 €
HSBC HOL 4.041 03/28	6 875 000	5 821 858,73 €
HSBC HOLD 1.50% 22	3 929 000	4 042 493,06 €
HSBC HOLD 3.375% 24	8 200 000	8 476 608,47 €
HSBC HOLD 6% 27	600 000	481 880,77 €
HSBC HOLD L3M 0524	3 925 000	3 426 653,93 €
HSBC HOLD L3M 1123	2 790 000	2 365 658,98 €
HSBC HOLDI 2.65 0122	3 000 000	2 575 233,64 €
HSBC HOLDINGS E3M+90	2 000 000	1 999 293,33 €
HSBC USA 5% 27/09/20	1 225	1 106 484,56 €
HSBCH LIBUS 0524	1 605 000	1 366 822,86 €
HUMANA INC 3.95 0327	2 800 000	2 413 146,13 €
HUNT 3550 1023	1 060 000	930 831,58 €
HUNT 5700 0423	1 750 000	1 374 771,46 €
HUNTINGT 4000 150525	830 000	732 049,14 €
HUNTINGTON 3.15 0321	2 000 000	1 755 198,36 €
HUNTSM 425 25	2 643 000	2 899 717,53 €
HUNTSM 5125 150421	5 570 000	6 000 918,41 €
HUNTSMAN 5125 1122	2 978 000	2 635 752,95 €
HYATT 4375 0928	4 587 000	3 964 763,84 €
HYUNDAI LIBUS 030420	4 000 000	3 499 978,13 €
IBER 1000 0324	2 200 000	2 239 014,08 €

IBERDR 1250 1026	3 000 000	2 974 846,56 €
IBERDR IN 1.875 0523	2 900 000	2 738 826,46 €
IBERDROLA 2.875% 20	7 500 000	7 922 274,44 €
IBERDROLA 1.125%2026	3 200 000	3 190 271,79 €
IBERDROLA 2625 1299	900 000	885 947,44 €
IBERDROLA 3% 22	9 600 000	10 650 700,12 €
IBERDROLA IN 3.5% 21	2 500 000	2 758 150,70 €
IBM 0.95 23/05/25	10 500 000	10 488 582,97 €
IBM CO 1800 170519	1 650 000	1 440 724,31 €
IBM CORP 1.125% 24	2 400 000	2 442 671,78 €
ICADE 1,125% 171125	3 300 000	3 142 891,39 €
ICADE 1.50 130927	2 300 000	2 183 457,71 €
ICAHN 5875 0222	2 050 000	1 808 274,41 €
IE2 HOLD 2875 010626	2 400 000	2 525 526,24 €
IGD 2.5% 31/05/2021	1 000 000	1 014 893,01 €
IHO 3750 0926	4 000 000	3 846 920,00 €
IHS MARK 4125 010823	2 260 000	1 992 084,44 €
ILL TOOL 1.75% 22	2 361 000	2 502 509,86 €
IMCOL 1625 1125	1 400 000	1 330 400,46 €
IMCOL 2500 1129	2 500 000	2 372 314,38 €
IMERYS 2.5% 13-2020	3 100 000	3 227 201,49 €
IMERYS SA 0.875%22	1 200 000	1 214 381,26 €
IMMO 2728 0623	2 000 000	2 132 164,04 €
IMS HEA INC 5 1026	3 000 000	2 553 978,04 €
IN GRP NV 1.125 225	8 900 000	8 803 425,03 €
INFRA PK 1625 190428	3 000 000	2 914 222,57 €
ING 2.50 01/10/19	1 500 000	1 313 802,50 €
ING 2000 0928	3 600 000	3 607 111,53 €
ING BANK 1.25% 2019	4 120 000	4 174 413,99 €
ING BANK 3.625% 26	1 500 000	1 630 590,15 €
ING BANK 4.5% 2022	5 000 000	5 833 021,02 €
ING BANK EUR3M+42 26	3 900 000	3 902 066,13 €
ING BANK NV e3m 1121	8 100 000	8 140 021,38 €
ING GP NV 1625 0928	7 100 000	6 769 885,75 €
ING GROEP 0750 0322	4 800 000	4 821 907,13 €
ING GROEP 1000 0923	7 800 000	7 772 686,83 €
ING GROEP 2.50 0229	2 900 000	2 988 043,70 €
ING GROEP 250 1130	8 400 000	8 670 147,05 €
ING GROEP 3.15 22	8 748 000	7 557 609,29 €
ING GROEP 3.95 27	380 000	320 219,81 €
ING GROEP NV	4 810 000	4 203 503,74 €
ING GROEP NV	2 725 000	2 406 497,33 €
ING GROUP 3000 0418	2 300 000	2 434 357,50 €
INGER 3750 0828	4 245 000	3 689 694,66 €
INMOBILIA 2% 0426	1 200 000	1 172 382,08 €
INMOBILIARIA 1.45%24	13 400 000	12 911 275,78 €
INNOGY 1500 310729	12 200 000	11 780 421,98 €
INNOGY F 1250 191027	4 117 000	4 013 311,46 €
INNOGY FI 1.625% 300	3 237 000	3 325 314,68 €
INNOGY FI 1000 0418	2 300 000	2 294 498,57 €
INT PAPER 3.80% 2026	3 900 000	3 407 270,26 €
INT SANPA 2125 0823	5 900 000	5 961 122,32 €
INTE SANPA 1.75 0328	3 167 000	2 923 950,69 €
INTEL 3.70% 2025	2 065 000	1 850 611,00 €
INTEL CO 3300 011021	1 550 000	1 378 889,62 €
INTEL CORP 2.7% 22	1 600 000	1 376 505,27 €
INTER 3500 1020	220 000	194 341,84 €
INTER 3750 1021	5 805 000	5 158 028,02 €
INTERCONT 2.35 15092	9 570 000	8 146 659,76 €
INTERCONTINENTA 2.12	9 413 000	9 301 199,36 €
INTERN 1800 250926	3 839 000	3 832 696,01 €
INTERNA 0500 250921	1 780 000	1 787 582,56 €
INTERP GRP 4.65 1028	885 000	775 860,46 €
INTESA 0875 0622	5 050 000	4 915 483,12 €

INTESA E3M 0422	1 750 000	1 694 549,89 €
INTESA SA 4.375%2019	3 200 000	3 326 940,93 €
INTESA SAN 1.125% 22	5 050 000	5 002 634,46 €
INTESA SAN 4% 23	8 918 000	9 759 799,34 €
INTESA SANP 2% 21	11 040 000	11 311 927,45 €
INTESA SANP 4.75% 24	1 300 000	1 225 864,03 €
INTESA SANP 5.25% 24	2 700 000	2 377 878,89 €
INTESA SANPA 3.5% 22	2 400 000	2 602 491,20 €
INTL LEASE 6.25 19	1 817 000	1 616 001,22 €
INTL LS FIN 5.875 22	2 000 000	1 857 657,94 €
INTL PAPER 3%16-2027	2 400 000	1 941 897,39 €
INVES 3125 1122	8 420 000	7 217 744,82 €
INVESTOR AB 150 0930	1 300 000	1 316 799,30 €
IREN SPA 1.95 25	5 050 000	4 955 638,81 €
IREN SPA 1500 241027	2 378 000	2 172 354,86 €
IRON MOUNT 6% 0823	1 625 000	1 460 886,59 €
ISS GLOBA 1.125% 21	4 000 000	4 097 516,45 €
ISTAR 5250 0922	2 275 000	1 890 191,36 €
ITALGAS 1125 0324	5 350 000	5 291 993,52 €
ITC HOLD 2700 1122	1 775 000	1 500 850,50 €
JAB 2500 0629	3 000 000	3 071 944,15 €
JAB HOLD 1.75% 23	3 000 000	3 131 384,04 €
JAB HOLDINGS	2 000 000	1 991 815,68 €
JABHG 1750 0626	3 600 000	3 630 912,77 €
JACK 2600 1220	2 050 000	1 773 426,79 €
JACKS 3875 0625	4 000 000	3 532 128,08 €
JAGUAR LR 4.5 27	1 750 000	1 156 945,72 €
JC DECAUX 1%16-2023	3 500 000	3 587 547,28 €
JCDECAUX SA 1020	3 300 000	3 290 151,61 €
JOHN DEERE 2.8 0323	2 815 000	2 422 478,46 €
JOHN DEERE 3650 1023	3 465 000	3 087 544,92 €
JOHNSON 0000 1220	2 278 000	2 264 370,04 €
JOHNSON 1% 150923	4 000 000	4 007 700,80 €
JOHNSON&JOHN 1.65%35	9 350 000	9 439 013,39 €
JP MORGAN 3.875%2020	128	6 877 485,87 €
JP MORGAN 4.5%12-22	22 820 000	20 940 840,92 €
JPM 4.625% 2021	7 500	6 790 047,42 €
JPMO CH L3M 01/02/28	9 070 000	7 827 489,28 €
JPMORG 4005 230429	5 395 000	4 663 525,97 €
JPMORGA 1638 1805828	14 429 000	14 565 700,99 €
JPMORGAN 1.375% 21	2 529 000	2 608 570,59 €
JPMORGAN 1.5% 25	4 498 000	4 636 722,37 €
JPMORGAN 2.625% 21	10 400 000	11 148 380,27 €
JPMORGAN 0000 0528	3 585 000	3 005 192,67 €
JPMORGAN 0625 250124	17 332 000	17 122 669,09 €
JPMORGAN 1.50% 2022	1 400 000	1 449 280,86 €
JPMORGAN 1.875%2019	6 000 000	6 116 093,42 €
JPMORGAN 2.295% 2021	4 700 000	4 040 390,37 €
JPMORGAN 2.55% 20	3 100 000	2 689 685,81 €
JPMORGAN 2.95% 2026	7 485 000	6 080 642,64 €
JPMORGAN 2750 230620	3 000 000	2 607 568,27 €
JPMORGAN 3.20%2023	6 250 000	5 457 368,04 €
JPMORGAN 3.875% 2024	6 900 000	6 011 526,96 €
JPMORGAN 3559 230424	10 000 000	8 713 732,04 €
JPMORGAN 4125 1226	5 800 000	4 960 873,46 €
JPMORGAN 6.75% 49	2 000 000	1 862 625,20 €
JPMORGAN Ch 4.95 320	4 760 000	4 308 983,60 €
JPMORGAN CHASE	2 128 000	1 786 886,25 €
JPMORGAN CHASE	3 400 000	3 441 116,15 €
JPMORGAN CHS 5.15 23	2 185 000	1 829 615,09 €
KAISER F 3150 010527	3 035 000	2 568 884,64 €
KAISER HOSP 3.5% 22	700 000	627 740,11 €
KANSAS CITY SOUT	920 000	795 686,19 €
KBC GP 0875 0623	5 300 000	5 308 878,53 €

KBC GP NV 1.625 0929	3 000 000	2 908 847,10 €
KBC GROEP 2.375% 24	6 200 000	6 313 631,56 €
KBC GROEP 1%16-2021	6 200 000	6 331 985,66 €
KBC GROEP TV 311299	9 980 000	9 937 722,23 €
KBC GRP 0750 010322	1 800 000	1 812 484,38 €
KBC GRP 0750 181023	3 000 000	2 968 935,88 €
KERING	5 600 000	5 676 403,52 €
KERR-MCGEE CORP	7 400 000	7 219 821,74 €
KEY BANK 1.60 08/19	2 100 000	1 830 567,00 €
KEY BANK NA	1 500 000	1 305 445,48 €
KEY BK 3400 200526	3 327 000	2 792 162,85 €
KEYBANK NA 2.25% 20	6 000 000	5 222 871,01 €
KEYCORP 2.9 15/09/20	3 500 000	3 064 838,39 €
KEYCORP 4.15% 1025	6 500 000	5 797 533,62 €
KILROY 3450 1224	735 000	622 787,37 €
KILROY RE 4.375 1025	2 000 000	1 772 926,66 €
KIMBELY-CL 0625 0924	3 500 000	3 490 990,12 €
KINDER 3150 0123	3 725 000	3 202 981,89 €
KINDER M 4150 010322	7 570 000	6 746 043,69 €
KINDER MORG 1.50% 22	5 000 000	5 133 649,48 €
KINDER MORG 3.95%22	3 975 000	3 504 377,64 €
KINDER MORGA 4.30%25	5 245 000	4 571 279,01 €
KINDR MORG 4.25% 24	2 000 000	1 762 065,84 €
KLEPIERRE 1% 2023	5 100 000	5 199 050,59 €
KLEPIERRE 1.62 32	2 900 000	2 663 524,52 €
KNORR 1125 0625	4 200 000	4 249 292,67 €
KOHL'S CORP 5.55 45	1 075 000	900 635,56 €
KON DSM 0.75% 2026	3 700 000	3 570 677,42 €
KONIN PH 1375 020528	4 700 000	4 617 900,97 €
KONINKL 0625 090425	3 000 000	2 891 366,59 €
KRAFT FDS 5.375% 24	2 860 000	2 609 740,79 €
KRAFT HEINZ 2.25% 28	4 060 000	4 030 175,54 €
KRAFT HZ 3% 01/06/26	630 000	494 375,80 €
KRAFT HZ 3.5% 150722	1 280 000	1 123 591,02 €
KROGER 1.5 09/19	1 605 000	1 389 855,73 €
KROGER CO 3.7 0827	760 000	642 120,54 €
KROGER CO/THE	3 000 000	2 672 157,35 €
LA BQE POS 1.00 24	6 000 000	5 864 467,70 €
LABO CORP 3.25 0924	7 561 000	6 403 874,90 €
LANDS 1000 0523	3 665 000	3 553 960,04 €
LANXESS 1.125 0525	2 400 000	2 372 465,96 €
LANXESS 4500 1276	1 605 000	1 666 718,19 €
IBBW 0,50 070622	4 200 000	4 223 200,01 €
LBP 2.75% 27	4 300 000	4 446 725,08 €
LBP 2000 0728	2 800 000	2 838 033,37 €
LEAR CORP	1 825 000	1 464 869,22 €
LEASE CORP 2.375% 19	510 000	521 884,26 €
LEASEPL E3M 1120	1 950 000	1 924 827,56 €
LEASEPLAN 0750 1022	7 774 000	7 452 966,53 €
LEASEPLAN 100 020523	2 200 000	2 108 635,38 €
LEASEPLAN CORP	1 700 000	1 713 188,02 €
LEG IMMOBI 1.25 0124	1 000 000	990 839,97 €
LEGRA 1000 0326	1 500 000	1 511 477,06 €
LENNAR 4750 1122	4 130 000	3 529 452,28 €
LENNAR CP 4.50 19	3 875 000	3 389 519,10 €
LEVEL 3 5.375 22	1 350 000	1 160 713,82 €
LEVEL 6125 0121	2 300 000	2 029 590,97 €
LEVI STRAUSS CO TV	250 000	250 698,75 €
LEXINGTON 4.40% 2024	1 700 000	1 471 013,43 €
LIBERTY MUTUAL E	4 411 000	4 472 341,78 €
LIBERTY PR 3.75 0425	2 000 000	1 739 637,55 €
LINCOLN NATL CRP	2 495 000	2 127 711,47 €
LLO BK GR 1.75 0928	4 810 000	4 492 800,38 €
LLOY BK 4550 0828	3 050 000	2 603 166,34 €

LLOY BKPLC 0625 0124	8 200 000	7 850 570,29 €
LLOYD 2700 0820	2 475 000	2 160 198,79 €
LLOYD 3000 0122	1 400 000	1 199 265,77 €
LLOYD 3574 1128	6 350 000	4 975 955,63 €
LLOYDS 2907 1123	9 735 000	8 089 651,73 €
LLOYDS 4.582 101225	1 050 000	866 303,86 €
LLOYDS 4050 0823	3 330 000	2 911 525,20 €
LLOYDS 7500 0925	1 470 000	1 235 512,40 €
LLOYDS BANK 4.65% 26	2 245 000	1 873 430,56 €
LLOYDS BK 1% 191121	7 000 000	7 099 837,34 €
LLOYDS TSB 6500 0320	6 000	6 698 776,96 €
LOGICOR FIN 150 1122	2 900 000	2 865 609,45 €
LOGICOR FIN 225 0525	2 550 000	2 497 684,55 €
LOGICOR FIN 325 1128	3 500 000	3 462 343,84 €
LONDON SE 0175 0929	1 117 000	1 092 635,54 €
LONDON SE 0875 0924	8 715 000	8 569 537,03 €
LONDON STOCK EXCHANG	6 560 000	6 409 890,58 €
LOWE'S C 2500 150426	2 375 000	1 855 179,40 €
LTD BRAND 6.625 0421	5 340 000	4 852 645,56 €
LVMH 0750 260524	2 000 000	2 014 413,49 €
LVMH MOET 0.37 22	1 826 000	1 835 801,64 €
LVMH MOET 1% 09/21	4 000 000	4 099 636,89 €
LYB INTL FI 4% 23	1 600 000	1 419 847,50 €
M&S L3M 0728	1 825 000	1 534 267,19 €
MACQ 4150 0324	3 600 000	3 168 959,45 €
MACQU 1250 0325	2 000 000	1 951 812,12 €
MACQUA GP L3M 1123	18 656 000	15 763 482,25 €
MACQUARIE 6.625%2021	1 200 000	1 125 601,78 €
MAGELLAN HLTH 4.4 24	3 150 000	2 593 447,49 €
MANPOW 1.875 09/2022	4 803 000	5 023 919,58 €
MANULIFE FIN4.15% 26	2 624 000	2 344 391,43 €
MAPFRE	2 000 000	2 016 976,23 €
MAPFRE 1.625% 26	5 700 000	5 664 237,09 €
MAPLE ESC 4.417 25	1 850 000	1 619 925,14 €
MARA PETRO 3.625% 24	4 665 000	4 005 517,59 €
MARAT 4400 0727	1 190 000	1 014 181,40 €
MARATHON 3800 0428	4 675 000	3 889 396,79 €
MARATHON 5125 0424	1 250 000	1 132 252,14 €
MARATHON 5125 1226	2 325 000	2 081 857,86 €
MARATHON 5375 1022	7 123 000	6 368 335,93 €
MARATHON OIL 2.8% 22	8 234 000	6 778 669,20 €
MARKEL 3.625%2023	4 000 000	3 498 174,63 €
MARRIOTT 3125 150626	1 000 000	793 038,97 €
MARRTTINTL 2.30 22	4 155 000	3 521 812,14 €
MARRTTINTL 3.75 25	11 150 000	9 528 471,47 €
MARSH & MCL 3.75 326	1 500 000	1 306 054,54 €
MASCO CORP 3.5 1127	1 520 000	1 229 159,19 €
MASTER 3500 260228	295 000	261 214,22 €
MASTERCARD 1.10 1222	3 200 000	3 293 696,07 €
MASTERCARD 3.375% 24	1 370 000	1 217 036,74 €
MATCH GROUP INC	2 000 000	1 795 594,04 €
MBANK 1058 0922	1 420 000	1 408 964,27 €
MCDO CORP 1.75% 28	5 000 000	5 072 916,88 €
MCDON 0625 0124	4 600 000	4 538 759,26 €
MCDONALD'S 1.125%22	5 000 000	5 143 740,83 €
MCDONALD'S 1875 27	2 000 000	2 082 801,22 €
MCDONALDS 3.35 23	3 040 000	2 668 602,53 €
MCDONALD'S 3.70%26	10 070 000	8 804 191,80 €
MCDONALD'S 3.8 28	2 000 000	1 735 574,70 €
MCDONALD'S CORP	700 000	599 080,42 €
MCKESSON CORP	3 000 000	2 612 775,23 €
MDC GMTN 4.50 28	1 400 000	1 263 214,80 €
MEAD JOHNSON 3%15-20	2 200 000	1 921 119,71 €
MEDIO SPA 0.625 0922	1 250 000	1 185 829,60 €

MEDIOBA 0750 170220	3 486 000	3 501 231,53 €
MEDIOBA E3M 180522	400 000	380 890,00 €
MEDTRONIC 3.5% 25	5 435 000	4 780 413,29 €
MERCI 1800 0226	3 000 000	2 765 003,01 €
MERCIALYS 1.787% 23	2 300 000	2 284 244,48 €
MERCK & CO 1.875% 26	918 000	979 555,84 €
MERCK & CO 2.35% 22	6 295 000	5 438 181,31 €
MERCK & CO 2.75% 25	520 000	444 891,29 €
MERCK 2.625% 74	4 660 000	4 827 029,08 €
MERCK FIN 4.5%10-20	900	981 576,80 €
MERCK NEW 2.40% 22	1 699 000	1 459 699,83 €
MERCK NEW 2.80%2023	3 500 000	3 024 638,06 €
MERLIN P 1750 260525	3 890 000	3 800 634,00 €
MERLIN PROP.2.225%23	1 316 000	1 372 709,21 €
MERLINENTT 2.75% 22	500 000	509 555,00 €
MET LIFE 0.875% 22	5 000 000	5 107 506,33 €
MET LIFE 2.375% 19	3 470 000	3 553 979,23 €
MET LIFE 2.375% 2023	6 006 000	6 576 907,85 €
MET LIFE 3450 091021	2 800 000	2 479 279,18 €
METLIFE 3% 03/25	1 675 000	1 416 261,36 €
MEXICO 3875 30/04/28	2 790 000	2 157 490,78 €
MFINANCE 1.398%2020	2 369 000	2 400 192,23 €
MGM RES 6625 151221	1 900 000	1 708 134,32 €
MI-ATL INT 4.1 0528	2 600 000	2 271 339,13 €
MICHELIN 0875 0925	3 900 000	3 871 821,56 €
MICHELIN 1750 0930	5 000 000	5 088 797,08 €
MICHELIN 2.5 38	4 200 000	4 356 159,21 €
MICROSOFT 1.85% 0220	4 804 000	4 197 523,81 €
MICROSOFT 2 080823	1 865 000	1 575 523,34 €
MICROSOFT 2.70% 2025	1 345 000	1 152 153,72 €
MICROSOFT 2875 0224	7 530 000	6 578 100,92 €
MICROSOFT 3.125% 28	6 000 000	7 166 505,96 €
MICROSOFT1550 080821	13 850 000	11 846 230,44 €
MICROSOFT2400 080826	1 955 000	1 614 273,79 €
MITSU 3761 0723	3 525 000	3 141 994,52 €
MITSUB FIN 2.95%2021	5 285 000	4 614 994,42 €
MITSUB UFJ FIN	1 150 000	1 151 817,51 €
MIZUH 2953 0222	2 000 000	1 730 260,19 €
MIZUHO 2273 0921	4 625 000	3 940 465,52 €
MIZUHO F 1020 111023	1 750 000	1 764 317,27 €
MIZUHO FIN E50 23	2 300 000	2 270 973,36 €
MOLSON 1.25% 24	1 494 000	1 480 108,95 €
MOLSON 2250 150320	1 795 000	1 557 676,55 €
MOLSON C 2100 150721	5 525 000	4 696 938,72 €
MOLSON CO 1.45% 19	1 250 000	1 090 207,61 €
MOLSON E3M 150319	2 648 000	2 646 989,57 €
MONDELEZ 3000 070520	4 350 000	3 805 566,64 €
MONDI FIN 1.50 24	2 121 000	2 135 933,58 €
MONDI FIN 1.62 26	3 781 000	3 753 283,60 €
MONDI FINAN 3.375%20	1 260 000	1 335 654,15 €
MONDIALE 5.05% 25	2 388 000	2 435 239,55 €
MOR STAN 1.342 1026	7 337 000	7 180 341,35 €
MORG 3737 0424	3 969 000	3 461 717,19 €
MORG 5.375% 08/20	40	2 208 243,80 €
MORG 5.625% 09/2019	1 850	1 667 670,25 €
MORG 5.75% 01/21	2 500	2 338 157,97 €
MORG Eurib3 05/21	5 500 000	5 463 536,83 €
MORGA STA 1.375 1026	1 940 000	1 884 877,12 €
MORGAN 1% 12/2022	8 331 000	8 388 762,26 €
MORGAN 2750 190522	2 100 000	1 789 360,39 €
MORGAN 3300 0426	2 190 000	1 834 690,55 €
MORGAN 3625 0127	8 855 000	7 485 042,41 €
MORGAN C&C 2.97 23	8 710 000	7 520 165,41 €
MORGAN C&C 4.35 21	4 000	3 637 090,50 €

MORGAN C&C 6.3% 19	2 690	2 404 727,99 €
MORGAN ST 2.5 0421	6 650 000	5 722 088,96 €
MORGAN STA 3.875% 26	3 869 000	3 342 477,78 €
MORGAN STA 4.875% 22	4 410 000	3 999 942,46 €
MORGAN STAN 1.75% 24	16 185 000	16 763 919,18 €
MORGAN STAN 2.375%21	758 000	805 491,01 €
MORGAN STAN 2.8 0620	900 000	781 985,74 €
MORGAN STAN 3.70% 24	1 158 000	1 002 773,85 €
MORGAN STAN 3.772 29	1 370 000	1 164 238,94 €
MORGAN STAN 3.875%24	2 000 000	1 749 462,26 €
MORGAN STAN 7.3%19	2 750	2 464 448,62 €
MORGAN STAN.3.125%26	5 725 000	4 676 113,62 €
MORGAN STAN.3.75%23	2 025 000	1 789 194,33 €
MORGAN STAN.3.95%27	1 785 000	1 484 104,66 €
MORGAN STAN.4.35% 26	3 670 000	3 152 754,68 €
MORGAN STANL 4.1% 23	3 600 000	3 161 599,09 €
MORGAN STANLEY	12 455 000	10 958 410,09 €
MORGAN STANLEY 4% 25	395 000	346 755,43 €
MORGAN STL 3.125 23	4 805 000	4 159 326,74 €
MOVIL SAB 5 03/20	742 000	668 489,11 €
MPLX 4000 0328	6 640 000	5 518 027,91 €
MPLX 4875 011224	11 317 000	10 114 301,66 €
MPLX LP 4% 2025	2 500 000	2 144 848,30 €
MPLX LP 4.5%23	325 000	292 998,95 €
MPLX LP 4125 010327	3 680 000	3 107 338,25 €
MPLX LP 480 0229	280 000	245 801,86 €
MPT 5000 1027	2 300 000	1 845 600,03 €
MPT OP 3325 240325	750 000	765 301,75 €
MPTOPERAT 4 08/22	450 000	486 150,16 €
MS 5.5%26/01/2020	11 000	10 061 765,49 €
MTNA 6.25% 2022	1 841 000	1 736 500,68 €
MUNICH RE 3,25% 2605	6 200 000	6 322 231,30 €
MYLAN 1250 231120	1 151 000	1 163 380,17 €
NA A B/NY 3.625 0623	6 350 000	5 570 041,40 €
NASDAQ OMX 3.875%21	2 000 000	2 212 372,64 €
NAT 1,125% 03/06/22	2 562 000	2 603 332,98 €
NAT AUS BK 2.75%2022	1 775 000	1 935 082,79 €
NATIO 4363 0824	6 800 000	5 942 298,54 €
NATION 1500 0326	2 523 000	2 424 326,89 €
NATION L3M 0329	800 000	663 508,73 €
NATIONAL RETAIL	4 413 000	3 703 731,32 €
NATIONWIDE 0625 0423	1 900 000	1 881 281,83 €
NATL 0875 1122	4 187 000	4 295 195,79 €
NATL 6875 0519	2 665 000	2 384 096,59 €
NATL AUST BK 0625 23	5 650 000	5 622 178,46 €
NATL AUSTR 2% 20	7 770 000	8 066 532,07 €
NATL AUSTRBK 1375 28	4 000 000	3 976 277,90 €
NATWEST 1125 0623	4 250 000	4 147 965,78 €
NATWST E3M 0921	8 907 000	8 777 712,42 €
NAVIT 5000 1020	1 725 000	1 465 915,09 €
NBC UNIVER 4.37% 21	1 655	1 501 756,04 €
NEDER 1375 1028	3 227 000	3 260 644,79 €
NES FIN IN 1.75 1137	2 400 000	2 438 438,89 €
NESTL 0875 0725	9 253 000	9 344 460,07 €
NESTLE HLD 3.50 25	4 500 000	3 992 172,94 €
NEUBERGE BE 4.5 0327	6 196 000	5 453 607,38 €
NEW Y LI GL 3 0128	1 900 000	1 599 491,47 €
NEW YORK L 2.9 0124	3 550 000	3 060 214,66 €
NEWELL RUBB 3.83 423	8 860 000	7 714 232,90 €
NEWELL RUBBE4.2 0426	4 360 000	3 751 218,41 €
NEWFIELD 5.75% 22	4 910 000	4 443 750,79 €
NEWS AMER 3%2022	4 248 000	3 711 254,06 €
NEXTERA 3550 010527	2 745 000	2 306 083,09 €
NGG FINANCE 4.25%76	1 415 000	1 476 879,69 €

NGGLN 1.00 120724	5 100 000	5 079 739,34 €
NIBC BK 1125 190423	6 050 000	5 990 755,23 €
NN GP 1625 0627	3 912 000	3 871 176,08 €
NN GROUP 0875 130123	5 521 000	5 573 854,05 €
NN GROUP 1% 2022	8 296 000	8 454 203,92 €
NN GROUP 4625 130148	3 506 000	3 725 064,97 €
NOKIA 3.375 06/22	515 000	424 469,54 €
NOMURA EUR 1.125%20	2 618 000	2 664 872,12 €
NOR 3ERM 0222	4 000 000	4 002 072,67 €
NORD BK AB 0.30 0622	5 000 000	4 999 743,93 €
NORDEA AB 0.87 23	1 818 000	1 815 078,60 €
NORDEA B 1 0926	1 150 000	1 146 528,35 €
NORDEA BANK 3.75 23	9 300 000	8 125 298,60 €
NORDEA BK 1.875%25	3 500 000	3 567 570,91 €
NORDEA BK 2.5%20	2 300 000	1 996 977,26 €
NORDSTROM 4% 03/27	5 475 000	4 580 292,61 €
NORF 3650 0825	760 000	676 111,61 €
NOS SGPS 1125 020523	2 500 000	2 505 180,48 €
NOVA 4875 0624	2 675 000	2 135 210,75 €
NOVA FIN 1.375 0830	1 600 000	1 599 527,54 €
NOVALIS OF 3% 2022	4 300 000	4 348 031,00 €
NOVARTI FIN 0.5 0823	5 500 000	5 569 746,09 €
NUCOR CORP	1 575 000	1 358 266,53 €
NUON FI 4500 1219	2 980 000	3 117 008,15 €
NUVEEN LLC 4% 1128	4 500 000	4 082 766,92 €
NVENT FINANCE	1 350 000	1 183 590,74 €
NVIDIA CORP 3.20% 26	1 229 000	1 030 602,34 €
NWIDE 2000 0729	3 900 000	3 651 150,79 €
NXP 4875 0324	10 219 000	9 017 788,13 €
NXP BV 5350 0326	5 000 000	4 469 590,60 €
NYK 0500 0122	1 700 000	1 687 254,03 €
NYKREDIT 0.37 20 E	2 922 000	2 926 812,15 €
NYKREDIT 0.75% 21	2 350 000	2 368 580,97 €
NYKREDIT 2.75% 27	4 500 000	4 682 716,18 €
OAT 0% 25/10/2023	330 000	330 844,80 €
OAT 3% 25/04/22	729 433 924	825 867 146,48 €
OAT 3.50% 25/04/20	582 180 863	627 426 197,99 €
OAT 4.25%07-23	815 626 000	993 363 698,50 €
OAT ZCP 25/04/2021	9 831 119	9 936 508,60 €
OAT ZCP 25/04/2022	9 831 119	9 937 098,46 €
OAT ZCP 25/04/2023	9 879 118	9 935 132,60 €
OCCID PETROL 3% 27	670 000	562 626,51 €
OHIO NAT FI 6.375 20	6 065 000	5 530 873,87 €
OMNICOM 4.45% 2020	3 200	2 895 013,49 €
OMNICOM GP 3.6%26	6 800 000	5 683 590,08 €
OMNICOM GRP 3.65% 24	1 300 000	1 108 489,65 €
OMV 1000 1226	2 200 000	2 161 623,96 €
OMV 2875 0324	8 200 000	7 981 737,24 €
OMV AG 0.75% 041223	250 000	250 977,86 €
OMV AG 1.75% 2019	309 000	314 497,07 €
OMV AG 1.875 1228	3 990 000	4 088 816,73 €
ONCOR 2.95%15-25	2 550 000	2 186 776,16 €
ONCOR ELEC 4.1% 06/2	1 500 000	1 348 949,54 €
ONCOR ELEC 7% 09/22	1 635 000	1 644 085,32 €
ONEOK INC 7.50% 2023	7 143 000	7 214 649,74 €
ONEOK PART 3.8% 20	4 000 000	3 548 055,81 €
OPTUS FINAN 3.5% 20	6 000 000	6 395 666,67 €
ORAC 2950 1124	7 630 000	6 501 290,84 €
ORAC 3250 1127	2 480 000	2 099 768,77 €
ORACL 2625 0223	3 200 000	2 754 669,12 €
ORACLE 3.125% 25	3 200 000	3 729 021,47 €
ORACLE 2.25 10/19	3 400 000	2 975 702,66 €
ORACLE 2.4% 23	2 550 000	2 153 050,78 €
ORACLE 3.875%2020	5 372 000	4 856 267,94 €



ORACLE CORP	1 925 000	1 581 739,34 €
ORACLE CORP 2.5% 22	3 000 000	2 565 008,97 €
ORANGE 1375 0328	4 700 000	4 665 076,59 €
ORANGE 0.875%16-2027	4 600 000	4 465 320,97 €
ORANGE 1% 052025	2 500 000	2 507 775,13 €
ORANGE 1.375 30	1 000 000	968 215,47 €
ORANGE 1000 120925	1 500 000	1 492 002,44 €
ORANGE 1625 031119	4 960 000	4 292 454,82 €
ORANGE 1875 120930	9 400 000	9 368 180,01 €
ORANGE 2.75% 2019	3 250 000	2 873 183,56 €
ORANGE 3.125% 24	3 500 000	4 013 210,60 €
ORANGE 4% 49	3 500 000	3 712 848,55 €
ORANGE 4.25% 20	10 411 000	11 069 986,71 €
ORANGE 5% 29/10/49	1 000 000	1 078 686,71 €
ORANGE 5.25% 2024	2 090 000	2 364 042,37 €
O'REI AUTO 4.35 0628	3 045 000	2 661 073,13 €
O'REILLY AUTO3.55%26	3 000 000	2 552 315,97 €
PAC GAS&E 3.30 1227	6 130 000	4 459 208,79 €
PACIFIC 3500 0625	1 030 000	776 777,59 €
PACIGA&ELE 2.95 0326	207 000	150 868,75 €
PACKAGING CP 2.45 20	1 900 000	1 638 929,71 €
PARKER-H 1125 010325	2 900 000	2 937 029,09 €
PARTNERRE 1.25% 2026	7 680 000	7 367 517,10 €
PASO NATL 8.625% 22	875	896 409,05 €
PATTERSON-UTI 3.95	2 750 000	2 228 092,46 €
PEMEX 3.75% 03/19	710 000	735 109,49 €
PENSK 3950 0325	7 860 000	6 854 413,75 €
PENSKE TRUCK 4.25%23	1 000 000	899 748,26 €
PEOPLE'S UNT 3.65%22	4 935 000	4 289 810,75 €
PEPSICO 0.875% 2028	5 000 000	4 812 581,86 €
PEPSICO 3.60% 2024	2 600 000	2 335 280,58 €
PERNOD RI 2.125% 24	3 000 000	3 198 257,94 €
PERNOD RIC 1.875% 23	800 000	848 460,86 €
PETR MEXI 5.35 0228	6 425 000	5 018 622,03 €
PETROLEOS MEX 5.5 21	3 000 000	2 679 832,04 €
PEUGE 2000 0325	3 800 000	3 762 178,28 €
PEUGEOT 2 24	2 000 000	2 030 329,87 €
PHOENI GP 4.375 0129	1 540 000	1 337 616,07 €
PIONEER NAT 3.45% 21	875 000	775 762,15 €
PIT BOWES 4950 0423	2 271 000	1 759 267,60 €
PKOBK 0750 0721	2 600 000	2 608 743,19 €
PLAIN 4500 1226	850 000	717 720,77 €
PLAINS ALL 2.6%19	2 925 000	2 523 639,29 €
PLAINS ALL 4.35%25	750 000	647 608,58 €
PNC BANK 3.10 1027	950 000	795 589,63 €
PNC BANK 4.05 28	2 380 000	2 123 777,59 €
PNC BANK N 2.45%20	3 740 000	3 239 590,26 €
PNC BANK NA	4 000 000	3 408 896,47 €
PNC FUND 3.3% 03/22	2 000 000	1 762 098,88 €
PNC FUNDING 6.7%19	1 820	1 622 899,89 €
PNC PITTSB 2.15% 25	6 100 000	5 216 401,65 €
POHJOLA BK 0875 0621	4 000 000	4 085 141,32 €
POSCO 4000 0823	1 425 000	1 276 508,92 €
POSTE 1450 1128	4 300 000	4 317 546,95 €
PPG INDS 0.875 1125	2 500 000	2 432 846,07 €
PPG INDS 0.875 22	3 900 000	3 976 686,44 €
PPG INDUS 0% 19	1 921 000	1 920 385,28 €
PRECISION 3250 0625	3 285 000	2 809 254,76 €
PRICEL GRP 2.375% 24	5 000 000	5 322 951,43 €
PRICELI GP 3.55 0328	1 195 000	991 531,69 €
PRICOA GLOB 2.55% 20	5 700 000	4 929 441,68 €
PRIN 2625 1120	4 015 000	3 484 929,15 €
PRINCIPFIN 3.10 26	1 825 000	1 498 416,29 €
PROCTER 0625 301024	3 900 000	3 897 169,82 €

PROCTER 1875 301038	1 191 000	1 229 170,77 €
PROCTER 4 7/8%27	2 570	3 435 962,55 €
PROGRECRP 5.375 0323	2 100 000	1 745 499,28 €
PROLINTL2 1.87 25	1 350 000	1 398 862,82 €
PROLOG LP 3.875 0928	1 600 000	1 432 315,97 €
PROLOGIS 1.375% 0521	5 700 000	5 872 526,12 €
PROLOGIS 1.375% 20	4 813 000	4 914 137,83 €
PROLOGIS 1750 0328	5 384 000	5 361 849,63 €
PROLOGIS 2375 141130	5 520 000	5 600 886,91 €
PROLOGIS 3% 01/22	6 631 000	7 280 995,97 €
PROLOGIS 3.375% 24	2 500 000	2 838 965,11 €
PROLOGIS 4.25%2023	5 000 000	4 579 415,07 €
PROSEGUR CASH	2 500 000	2 379 846,80 €
PROSEGUR SA 1 23	1 100 000	1 093 556,97 €
PROXIMUS 0.5 220322	4 000 000	4 048 130,43 €
PRUD 4.50% 2021	3 000	2 720 286,05 €
PRUDENT 7.575% 2019	1 000	894 079,95 €
PRUDENT FI 3.50 24	1 000 000	880 292,76 €
PRUDENT FI 4.5% 2020	9 240	8 308 119,14 €
PSA BAN F 0.75 0423	3 100 000	3 026 203,63 €
PSA BANQ 0625 1022	4 900 000	4 792 026,44 €
PSA BANQUE FR 0.5 20	2 500 000	2 515 989,05 €
PSE&G 3 15/05/25	2 000 000	1 707 527,45 €
PTN RE FIN 5.5 20	4 325 000	3 908 253,68 €
PUBLIC 2650 1122	1 850 000	1 565 680,07 €
PUBLICIS 1.125% 2021	1 200 000	1 224 552,11 €
PUBLICIS GRP 0.50%23	1 500 000	1 471 955,87 €
PUGET ENERGY INC	2 000 000	1 893 522,28 €
PUGET ENGY 6% 21	2 000 000	1 886 792,35 €
PVH CORP 3.625 24	3 000 000	3 206 078,81 €
PZU FIN 1.375% 19	4 911 000	4 972 689,56 €
QUALC 3250 0527	10 185 000	8 318 725,10 €
QVC 4.45% 15/02/2025	710 000	581 762,34 €
QVC INC 4.375% 2023	1 250 000	1 063 678,21 €
RABOBANK 075 23	3 900 000	3 897 348,74 €
RABOBANK 2.50% 2026	9 500 000	9 976 321,26 €
RABOBANK 3.75% 2020	8 650	9 233 930,23 €
RABOBANK 3.875% 2023	1 500 000	1 703 298,20 €
RABOBANK 4,75%0622	6 192	7 298 294,94 €
RABOBANK 4.625% 23	2 375 000	2 111 833,65 €
RABOBANK 5.5% 20	9 150 000	9 369 924,78 €
RABOBANK 6.875 0320	4 500 000	5 101 529,80 €
RABOBANK N 2.5 0121	7 000 000	6 088 398,04 €
RABOBANK NL 3.875%22	2 300 000	2 059 985,63 €
RABOBK 5 7/8% 05/19	6 960	7 365 480,06 €
RABOBK NL 4.125% 22	4 300 000	4 839 900,78 €
RAIFFE BK IN 1% 1223	5 600 000	5 588 600,74 €
RAIFFEISEN 0.25 21	3 900 000	3 885 055,11 €
RAIFFEISEN BK 4.5%25	6 000 000	6 410 873,43 €
RAYMOND 5620 2424	8 167 000	7 817 965,51 €
RB SCOTLD 6.4 19	2 220	2 011 564,89 €
RBS GRP PLC 5.375%19	7 300	7 675 364,00 €
RCI 1 17/05/23	2 000 000	1 969 623,53 €
RCI 1.625 04/25	2 800 000	2 791 267,04 €
RCI BANQUE	5 265 000	5 239 516,18 €
RCI BANQUE 0.5%2023	4 068 000	3 883 269,88 €
RCI BANQUE 0.625% 20	5 000 000	5 042 448,02 €
RCI BANQUE 0250 0721	4 000 000	3 940 703,32 €
RCI BANQUE E3M 0123	2 750 000	2 605 840,11 €
RCI BANQUE E3M 24	1 450 000	1 336 929,00 €
RCI BQE 0750 260922	10 086 000	9 880 766,51 €
RCI BQE 1375 080324	1 900 000	1 888 802,05 €
RCI BQUE 1.625 26	13 000 000	12 661 002,94 €
REALTY 3650 150128	4 575 000	3 923 991,82 €

REALTY IN. 3.875% 24	830 000	741 437,14 €
REALTY INCOM 4125 26	765 000	678 704,54 €
RECKITT 2750 0624	8 000 000	6 606 900,04 €
RED EL 2,125% 2023	5 500 000	5 955 943,22 €
RED ELECT 1250 0327	5 300 000	5 327 265,78 €
REDEXIS GAS 1.875 27	1 150 000	1 106 302,92 €
REGIONS 3374 0821	2 055 000	1 811 220,73 €
REGIONS 3800 0823	8 413 000	7 464 934,26 €
REGLP FIN 5% 2022	5 366 000	4 846 264,67 €
REGLP FIN 5.875% 22	1 140 000	1 055 383,53 €
RELFINANCE 0375 321	4 255 000	4 273 133,24 €
RELIANCE ST 4.5%23	1 719 000	1 520 491,33 €
RELX CAPI 1.30% 25	2 450 000	2 428 085,68 €
REN 1750 0128	3 730 000	3 695 575,17 €
RENAULT 1 11/25	500 000	468 676,35 €
RENAULT 1% 0424	4 400 000	4 270 070,15 €
RENAULT 2000 0926	3 000 000	2 979 448,71 €
RENFINANCE 4.75%2020	4 300 000	4 670 620,53 €
REP SVCS 3.375 1127	450 000	380 454,01 €
REP SVC 3.95 0528	500 000	441 073,64 €
REPSOL 2.625% 2020	2 500 000	2 624 865,05 €
REPSOL INT 3.875% 21	6 500 000	6 857 439,45 €
RICHEMO INT 2 0338	400 000	397 387,42 €
RIO TINTO 3.75% 25	192 000	167 731,06 €
ROAD FIN 1.625 1224	3 824 000	3 639 924,16 €
ROAD FIN 2.375 1227	656 000	604 360,85 €
ROCK 4900 01/03/2022	2 125 000	1 938 060,89 €
ROCKIES 6.875% 0440	1 500 000	1 398 026,29 €
ROCK-T 4000 010323	1 335 000	1 178 039,03 €
ROCKWELL 3,2 150324	1 360 000	1 154 551,55 €
ROCKWELL COLLINS	1 145 000	956 345,19 €
ROGERS COMM 3.625%25	1 045 000	892 898,40 €
ROPER IND 3.125% 22	2 000 000	1 724 667,22 €
ROPER TECH 3% 2020	5 489 000	4 784 070,56 €
ROYA BK CA 4.65 0126	3 270 000	2 986 608,58 €
ROYA BK SC 0625 0322	1 979 000	1 930 225,47 €
ROYAL BK 2000 080323	5 036 000	5 132 058,43 €
ROYAL BK 3.875% 2023	27 015 000	22 919 985,81 €
ROYAL BK 4800 050426	3 390 000	2 921 017,63 €
ROYAL BK SC 4.892 29	855 000	718 453,55 €
ROYAL BK SCOT 0326	2 090 000	2 023 032,38 €
ROYAL BK SCOT 2 25	6 500 000	6 407 107,44 €
ROYAL CAR 2.65 1120	2 400 000	2 064 141,48 €
ROYAL SCHIP 1.5 1130	1 875 000	1 900 131,86 €
ROYCE 0.875 05/24	4 900 000	4 759 171,32 €
RTE RES 1500 0930	1 000 000	987 538,30 €
RTE RESEAU 1.875 37	2 700 000	2 650 009,04 €
RTE RESEAU 2125 0938	1 600 000	1 596 736,29 €
RWE 5,75%33 EMTN	700	1 009 489,57 €
RWE FINANCE 1.875%20	5 000 000	5 188 139,57 €
RY SYS IN 2.875 0920	3 500 000	3 061 112,45 €
RYANAIR 1.875% 21	2 613 000	2 716 864,85 €
RYDER SYSTEM 2.5 010	450 000	379 970,70 €
SABINE 5875 0626	650 000	603 567,54 €
SABINE P 5625 010221	6 700 000	6 159 029,87 €
SABINE PL 5 03/27	1 005 000	898 587,72 €
SABINE PL 5.75 24	13 970 000	12 884 890,55 €
SALESFORCE.COM	905 000	802 104,61 €
SALINI IMPREGILO	500 000	320 799,11 €
SAMMONS FIN 4.45 27	7 000 000	6 070 366,24 €
SAMPO 1250 0525	6 000 000	5 978 254,52 €
SAMPO OYJ 1 0923	13 850 000	13 953 505,30 €
SAMPO OYJ 2.25 0930	1 450 000	1 449 649,90 €
SAMV 1800 0724	1 054 000	836 981,40 €

SANCO 0750 0323	600 000	598 951,54 €
SANEF 0.95% 1028	3 900 000	3 664 042,52 €
SANOFI 1% 0326	6 000 000	6 122 239,87 €
SANOFI 0.50 0323	9 200 000	9 320 134,57 €
SANOFI 1.75% 14-2026	200 000	212 946,82 €
SANT 0750 0921	2 000 000	1 995 637,87 €
SANT FIN 4.125 0927	4 700 000	3 708 810,78 €
SANT HDGS 3.70 22	6 830 000	5 917 325,16 €
SANTAN 1125 091023	5 400 000	5 389 938,10 €
SANTAN 3125 190127	800 000	827 084,03 €
SANTAN C 0875 240122	500 000	505 574,79 €
SANTAN CONS 1 0521	4 000 000	4 077 716,77 €
SANTAN UK 2.87 21	6 220 000	5 329 233,56 €
SANTAN UK 4.796 1124	3 000 000	2 624 943,36 €
SANTAND 156 110422	5 800 000	5 088 452,63 €
SANTAND IS 3.25% 26	1 100 000	1 151 765,74 €
SANTAND ISSU 2.5% 25	2 000 000	2 035 611,21 €
SANTAND UK 5 23	5 965 000	5 145 756,45 €
SANTANDER 2125 1120	2 050 000	1 747 456,96 €
SANTANDER 2500 0121	2 500 000	2 161 223,62 €
SANTANDER 4.50% 2025	2 825 000	2 491 332,94 €
SANTANDER INTL	10 200 000	10 483 304,24 €
SANTANDER INTL 4%20	2 200 000	2 376 236,57 €
SANTANDEU 1.125 0923	5 700 000	5 492 492,43 €
SANTC BK 0.75 1022	1 800 000	1 782 834,37 €
SANTD 3.5 0422	3 200 000	2 761 946,47 €
SANUK 3823 1128	2 170 000	1 714 723,63 €
SAP 0,75% 101224	9 100 000	9 099 710,18 €
SAP SE 1% 13/03/2026	300 000	302 760,78 €
SAP SE 1.25 0328	5 000 000	5 009 909,59 €
SAP SE 1.375 032030	1 400 000	1 399 114,62 €
SAP SE 1.625 0331	3 000 000	3 003 865,48 €
SAP SE E3M 0321	2 500 000	2 496 675,00 €
SAPRR Eurib3 19	3 600 000	3 604 740,30 €
SCA HYGIE 1.625 327	1 482 000	1 499 428,22 €
SCA HYGIEN 1.125 324	5 550 000	5 638 248,22 €
SCENTRE MG 1.5% 20	6 967 000	7 138 124,13 €
SCENTRE MGM 1375 323	2 306 000	2 383 878,56 €
SCHAEFF 3500 150522	7 500 000	7 555 025,00 €
SCHAEFFLFI 3.25% 25	7 888 000	8 136 932,13 €
SCHLMB NOR 4.20 21	2 303 000	2 079 398,57 €
SCHLUM FIN 1 02/26	2 332 000	2 339 024,08 €
SCHNEID 0875 1226	2 000 000	1 958 145,85 €
SCOR 3%15-2046	9 500 000	9 594 221,78 €
SELECT INCOM 4.15%22	4 825 000	4 255 582,14 €
SELP FI SA 1.50 1125	2 300 000	2 190 888,50 €
SEMPRA 9.8% 15/02/19	815	744 865,49 €
SERVICE COR 5.375%24	2 750 000	2 371 513,65 €
SES SA 3.6% 23	6 700 000	5 781 640,20 €
SG 2.5% 2026	900 000	926 409,02 €
SG 0250 0122	5 700 000	5 671 121,39 €
SG 0750 26/05/23	6 400 000	6 477 010,21 €
SG 2.625% 27/02/25	800 000	831 091,06 €
SG 2125 270928	2 900 000	2 893 455,51 €
SG 4.25% 2022	3 800 000	4 383 070,00 €
SG Eurib3 03/23	5 200 000	5 004 397,95 €
SGOB 1125 0326	7 400 000	7 234 161,33 €
SGSP AUSTR 2 22	5 000 000	5 301 755,88 €
SHELL IN 0.375% 25	3 200 000	3 121 796,22 €
SHELL INTF 1.75 21	3 625 000	3 076 392,98 €
SHELL INTL 1.625% 27	2 170 000	2 285 215,18 €
SHELL INTL 350 1123	2 580 000	2 289 401,28 €
SHELL INTL FIN	1 435 000	1 250 325,18 €
SHELL INTL2.125% 20	3 275 000	2 840 680,95 €

SHERW 3125 0624	3 000 000	2 512 866,49 €
SHERW WILL 2.75 22	6 765 000	5 731 531,49 €
SHIRE ACQ 1.90% 2019	3 475 000	3 013 787,81 €
SHIRE ACQ 2.875%2023	1 390 000	1 159 416,87 €
SHIRE ACQ IN 2.4 921	5 645 000	4 798 048,37 €
SIEMENS FI 1375 0930	3 405 000	3 393 773,98 €
SIEMENS FIN.2.35% 26	1 950 000	1 556 215,94 €
SIGMA 4875 0328	2 675 000	2 254 474,04 €
SIMON INTL 1.375% 22	1 808 000	1 856 424,35 €
SIMON PROP 2.50% 21	8 000 000	6 954 374,61 €
SISIM 1625 0228	2 900 000	2 602 872,55 €
SKANDINAV 2.5% 2026	5 000 000	5 242 111,97 €
SKANDINAV 2.625%2021	2 490 000	2 161 953,42 €
SKANDINAV ENSKIL	3 750 000	3 245 683,53 €
SKY PL 2.875% 11/20	3 500 000	3 018 489,54 €
SKY PLC 2.25% 25	1 800 000	1 896 088,97 €
SKY PLC 2.50 09/26	11 618 000	12 413 909,06 €
SL GREEN O 3.25 1022	17 541 000	14 934 465,05 €
SLB 0,625% 19	4 760 000	4 789 631,33 €
SMBC 2.25 07/19	6 600 000	5 807 584,31 €
SMBC AVIATIO 4125 23	4 666 000	4 162 730,99 €
SMITHFI FO 2.65 1021	1 500 000	1 260 641,65 €
SMURFIT 2.875% 0126	3 050 000	3 062 335,13 €
SMURFIT 2375 0224	1 982 000	2 012 419,30 €
SMURFIT AC 4.12 20	2 050 000	2 151 354,56 €
SNAM 0.875% 16-2026	1 400 000	1 302 099,51 €
SNAM 0000 251020	4 512 000	4 488 621,52 €
SNAM 1000 0923	1 701 000	1 702 173,20 €
SNAM 1375 1027	1 400 000	1 312 993,76 €
SNS BANK TV051125	7 500 000	7 900 096,83 €
SNTDER UK 3.571% 23	5 070 000	4 323 174,07 €
SOC GEN 4% 23	1 800 000	2 014 950,96 €
SOCIETE 1125 0125	4 900 000	4 810 245,54 €
SOCIETE G 1% 04/22	8 900 000	8 994 727,51 €
SOCIETE GE 0.5 0123	4 700 000	4 608 290,92 €
SODEXO 0750 14042027	3 800 000	3 661 062,72 €
SODEXO SA 1.125 0525	300 000	305 251,73 €
SOFTBANK 4.75 25	500 000	517 418,75 €
SOGE 1375 0228	4 000 000	3 886 711,87 €
SOGECAP 4.125% 99	1 200 000	1 236 155,60 €
SOLVAY 4.25% 040324	1 200 000	1 202 787,78 €
SOLVAY FI 4.199% 49	7 000 000	7 249 967,89 €
SOLVAYF 5869 1299	1 688 000	1 879 486,77 €
SOUT CAL ED 3.7 0825	3 630 000	3 202 806,79 €
SOUTHERN P 1.95 1219	2 700 000	2 328 273,19 €
SP GLOBAL 3.30%2020	7 540 000	6 691 262,19 €
SPAREB VT 0.50 1122	1 000 000	994 099,45 €
SPCM 2.875 06/23	1 000 000	1 001 607,50 €
SPECTRA PA 3.50 25	1 400 000	1 179 066,61 €
SPECTRA PARTNERS	2 750 000	2 270 972,21 €
SPI ELECT 2.375% 20	4 100 000	4 284 970,95 €
SPIRT AERO 3.85 26	2 930 000	2 360 724,18 €
SPRINT SPECT 3.36%21	5 000 000	2 972 260,49 €
SSE PLC 1.375% 27	1 600 000	1 543 630,43 €
ST FONCIERE 1.875%21	2 400 000	2 485 612,93 €
ST GOBAIN 1.875 28	3 100 000	3 089 868,17 €
STAND CHART 4.05% 26	2 925 000	2 450 824,53 €
STANDARD 0750 1023	12 980 000	12 577 023,07 €
STANDARD 1625 1027	2 450 000	2 347 943,51 €
STANDARD CH 2.1 0819	3 875 000	3 388 016,30 €
STAR 5000 1221	2 050 000	1 764 759,22 €
STARBUCKS 3.80 25	4 975 000	4 358 383,07 €
STATE ST LIBOR 0647	8 305 000	5 812 583,65 €
STATE STRE 5625 1223	1 295 000	1 080 874,42 €

STATE STREET 1.95%21	3 350 000	2 854 403,77 €
STATE STREET 3.55%25	1 500 000	1 324 383,28 €
STATE STREET CRP	8 870 000	7 866 080,86 €
STATOIL 2.875% 25	4 000 000	4 555 722,08 €
STATSTREET 2.55%2020	2 400 000	2 098 837,42 €
STD CHART 3.125% 24	1 223 000	1 262 180,93 €
STDER CS BK 0.375 20	4 700 000	4 723 802,54 €
STE AUTO 1.875% 25	1 100 000	1 182 061,94 €
STE AUTO 2.25% 20	5 000 000	5 224 525,16 €
STE FONCIERE 2.25%22	400 000	420 931,56 €
STEDIN HOLDING	4 435 000	4 417 926,37 €
STGOBAIN 4.50 19	1 330	1 390 252,10 €
STRYKER 2125 311127	7 227 000	7 444 473,09 €
STRYKER 2625 301130	1 429 000	1 471 551,91 €
STRYKER CO 3.37 24	2 000 000	1 734 820,45 €
STRYKER CP 3375 1125	3 000 000	2 536 340,38 €
SUEZ	5 600 000	5 659 634,51 €
SUEZ 2875 1299	600 000	587 883,41 €
SUEZ CO 1 030425	3 300 000	3 350 027,17 €
SUMIT MIT 10.74 1022	7 530 000	6 584 436,59 €
SUMIT MITSU 2.058%21	6 670 000	5 697 119,78 €
SUMITOMO 0819 0723	3 550 000	3 560 715,64 €
SUMITOMO 2.25%20	4 789 000	4 992 474,02 €
SUMITOMO MI 0.934 24	4 000 000	3 970 618,32 €
SUMITOMO MITSUI	2 500 000	2 196 107,97 €
SUMITOMO MITSUI	8 680 000	7 483 061,30 €
SUMITOMO MITSUI	100 000	100 504,11 €
SUMITOMO MITSUI 1%22	3 390 000	3 477 705,89 €
SUNOCO LOG 4.25% 24	2 675 000	2 311 737,06 €
SUNOCO LS 4 011027	1 010 000	820 079,73 €
SUNT 3689 0824	1 880 000	1 658 587,32 €
SUNTRUST 4000 010525	7 252 000	6 394 364,58 €
SVB FINANC. 5.375%20	4 500	4 125 344,44 €
SVENS 3350 0521	1 160 000	1 016 281,53 €
SVENSKA 1.625 0329	3 357 000	3 339 685,49 €
SVENSKA 1250 020328	2 800 000	2 791 498,64 €
SVENSKA 2.656% 24	2 600 000	2 666 577,67 €
SVENSKA HAND 2.4% 20	4 400 000	3 810 266,96 €
SVENSKA HND 1.875%21	5 250 000	4 437 902,94 €
SVENSKA HNDL 1.95 20	2 659 000	2 289 066,42 €
SVENSKA HNDL 2.45%21	6 300 000	5 429 353,76 €
SVENSKA HNDLSBKN	17 297 000	17 741 940,04 €
SWEDB 1500 0928	1 350 000	1 340 319,91 €
SWEDBANK 0250 1122	5 000 000	4 964 903,56 €
SWEDBANK AB 2.8 0322	4 725 000	4 086 806,85 €
SWEDBANK VRN 24	4 200 000	4 298 390,46 €
SWISS BV 2.6% 25	6 600 000	6 612 921,99 €
SWISSCOM AG 1.125 26	7 745 000	7 730 658,73 €
SYDNEY 1750 0428	4 153 000	4 233 086,42 €
SYDNEY AIR 2.75% 22	9 300 000	10 344 194,97 €
SYNCHRON 3.70 26	1 825 000	1 385 147,92 €
SYNCHRON 3.95 27	3 275 000	2 416 022,95 €
SYNGEN NV 4.89 25	3 750 000	3 113 883,79 €
TADEKA 1125 1122	6 830 000	6 870 195,53 €
TADEKA 3000 1130	6 285 000	6 416 960,15 €
TADEKA P 0375 211120	2 300 000	2 299 351,82 €
TAKEDA 5000 1128	6 750 000	6 057 781,13 €
TAKEDA PHARMA 3,8% 2	5 846 000	5 172 727,14 €
TAKEDA PHARMA 4,4% 2	1 545 000	1 377 562,11 €
TALANX 8.3673% 42	5 300 000	6 639 601,50 €
TALANX AG 3.125% 23	6 000 000	6 817 222,36 €
TALANX E3M 1247	11 500 000	10 409 575,41 €
TCP 3900 0527	855 000	710 661,33 €
TD AMERITR 3.3 0427	1 550 000	1 304 911,58 €

TD AMERITR 3.62 25	2 750 000	2 400 542,96 €
TDF 2.5% 07/04/26	3 400 000	3 501 352,11 €
TDF INFRA TF 22	1 000 000	1 069 310,50 €
TDOM 3150 0920	3 150 000	2 790 553,08 €
TEL.ITA.7,75%33	246	325 497,63 €
TELE 1875 0725	900 000	901 894,16 €
TELE2 AB	1 900 000	1 885 202,75 €
TELE2 AB	3 948 000	3 900 405,44 €
TELEF EM 1.447 0127	5 400 000	5 316 016,86 €
TELEF SAU 5.134% 20	3 525 000	3 183 253,48 €
TELEF SAU 5.462 21	1 625 000	1 501 806,11 €
TELEFO 2625 0623	7 700 000	7 175 497,10 €
TELEFON E 1.528 125	6 000 000	6 163 752,71 €
TELEFON.5 7/8%33	2 000	2 874 492,05 €
TELEFONIC 0.318% 20	5 000 000	5 016 088,81 €
TELEFONICA 2.242% 22	2 800 000	2 995 985,86 €
TELEFONICA 4 1223	700 000	650 353,03 €
TELEFONICA 4.71%20	8 300 000	9 077 524,92 €
TELEFONICA 8.25%30	1 500	1 699 671,96 €
TELEFONICA EMIS	4 511 000	3 845 238,54 €
TELEFONICA TVPERP.	2 000 000	1 830 509,86 €
TELEKFIMA 3.125% 21	15 353 000	16 616 444,58 €
TELEKOM FIN 1.5%26	15 200 000	15 287 892,31 €
TELENOR 4.125%10-20	2 000	2 167 298,35 €
TELFON DEUT 2.375%21	6 473 000	6 878 960,00 €
TELFONICA D 1.75 25	3 900 000	3 933 388,39 €
TELIA CO 3000 040478	1 500 000	1 497 030,82 €
TELIASONER 3.875% 25	3 000	3 511 462,96 €
TELIASONERA 3% 0927	1 735 000	1 943 902,03 €
TELNO 2625 1224	3 137 000	3 445 804,08 €
TELSTRA 4.25% 2020	3 130	3 399 580,86 €
TENN 1375 0628	9 000 000	9 088 480,81 €
TENNET H 2995 010624	7 300 000	7 229 802,00 €
TENNET HL 0.75 06/25	700 000	696 455,66 €
TEOLL VOI 2% 0524	2 060 000	2 083 918,01 €
TEOLL VOIM 2.625%23	1 817 000	1 939 067,55 €
TERNA 4.875%10/19	667	698 861,04 €
TERNA SPA	8 344 000	7 904 521,26 €
TERNA SPA 1 0723	700 000	702 823,42 €
TES L LP 6.25% 10/22	196 000	177 092,11 €
TES LOG L 6.375 0524	2 810 000	2 579 500,03 €
TESC C TR 1.375 1023	8 995 000	8 785 098,60 €
TESORO 5250 0125	4 457 000	4 005 237,25 €
TESORO 5500 1019	1 755 000	1 567 619,87 €
TEVA FNC 1,25% 03/23	750 000	685 942,91 €
TEVA PH 2200 011021	1 635 000	1 323 933,08 €
TEVA PHA 6.75 0328	3 075 000	2 646 399,10 €
TEVA PHARM 0.375% 20	1 761 000	1 717 211,65 €
TEVA PHARM 1.125% 24	2 966 000	2 495 223,89 €
TEVA PHARMA 1.70%19	1 590 000	1 376 712,65 €
TEVA PHARMA 2.80% 23	575 000	438 909,37 €
THALES 0750 0125	600 000	594 493,58 €
THALES SA	2 400 000	2 409 520,81 €
THERM 1400 0126	6 060 000	6 041 264,76 €
THERMO 1450 0327	3 250 000	3 197 889,26 €
THERMO FISH 2.95%26	2 850 000	2 328 870,52 €
THERMO FISH3.3%02/22	2 350 000	2 068 612,61 €
THERMO FISHE 0.75%24	989 000	961 478,22 €
THERMO FISHER 3% 23	370 000	316 096,49 €
THYSS 1.375 030322	3 350 000	3 307 647,28 €
TIME WAR 3.6% 25	1 895 000	1 595 254,65 €
TIME WARNR 3.80 27	2 135 000	1 777 302,14 €
TLG IM 1375 1124	2 600 000	2 539 039,97 €
TMOB 6000 0323	3 565 000	3 178 681,21 €

T-MOBILE 0000 150126	2 200 000	- €
TORO 1850 0920	8 050 000	6 955 650,38 €
TORONTO 0375 120121	3 400 000	3 443 290,62 €
TORONTO BK 2.5% 20	4 000 000	3 465 719,97 €
TORONTO DM 1.80 21	5 125 000	4 374 283,78 €
TORONTO L3M 0621	2 710 000	2 362 357,42 €
TOT SYS 4% 0623	2 028 000	1 771 695,77 €
TOTAL CAP 0625 1024	3 200 000	3 188 364,54 €
TOTAL CAP 1.023 27	2 800 000	2 790 631,24 €
TOTAL CAP 1.875% 20	5 000 000	5 194 114,18 €
TOTAL CAP 1375 1029	7 200 000	7 181 243,15 €
TOTAL CAP 2.875% 25	500 000	565 478,36 €
TOTAL CAPI 0.75%28	7 000 000	6 688 439,03 €
TOTAL S.A. 2.708% 49	5 700 000	5 896 813,04 €
TOTAL S.A. 3.369%26	1 500 000	1 539 552,18 €
TOTAL SA 2.25% 49	30 560 000	31 370 999,24 €
TOTAL SA 2.625% 49	6 955 000	7 033 821,97 €
TOTAL SA 3.875% 22	4 500 000	4 873 205,29 €
TOTAL SYST 3.75% 23	645 000	558 584,35 €
TOTAL SYSTE 3.8 0421	5 965 000	5 269 389,17 €
TOYOTA MTR 1.80%2020	1 600 000	1 657 783,95 €
TR INFR 2.2 05/08/25	3 300 000	3 457 249,19 €
TRANS ALLEGHENY 3.85	2 275 000	1 993 940,48 €
TRANS-CANADA 3.8% 20	1 000	886 157,64 €
TRANSCANADA 5.875%76	368 000	307 437,93 €
TRANSURB 2000 0825	3 028 000	3 127 560,64 €
TRANSURBA 3.375 0327	3 675 000	3 011 493,16 €
TRANSURBAN 1.87% 24	2 982 000	3 093 977,42 €
TRIMBLE 4900 0628	2 625 000	2 239 683,11 €
TRINITY A 2.12512 22	3 874 000	4 037 113,45 €
TRINITY ACQ 3.5% 21	1 735 000	1 516 354,94 €
TWARN CABL 4% 21	6 000 000	5 293 087,82 €
TWARN CABL 4.125%21	1 500 000	1 337 032,54 €
TWARN CABL 8.25 19	2 650 000	2 394 662,84 €
TYCO ELEC 3.125 0827	775 000	636 900,76 €
TYCO ELECTR 1.1% 23	8 131 000	8 326 543,98 €
TYSON 3550 0627	2 025 000	1 655 051,01 €
TYSON FOODS 2.65% 19	7 835 000	6 885 522,15 €
TYSON FOODS 4.5%22	2 235 000	2 001 401,78 €
UBS 0250 0122	15 563 000	15 520 772,21 €
UBS 1250 0425	13 692 000	13 612 923,98 €
UBS AG 4.75% 2026	13 414 000	14 758 675,25 €
UBS AG LDN 0.625 230	9 719 000	9 755 394,14 €
UBS AG LOND 1.25% 21	3 610 000	3 720 490,48 €
UBS AG STA 2.35% 20	6 800 000	5 920 172,52 €
UBS GRO F 3.491 0523	1 875 000	1 609 055,39 €
UBS GROUP 1.75% 22	1 430 000	1 478 526,72 €
UBS GROUP FUNDIN	1 000 000	1 060 482,15 €
UBS GROUP FUNDIN	4 500 000	4 392 829,69 €
UBS GROUP FUNDIN	10 110 000	8 777 044,19 €
UBS LDN 0125 051121	5 000 000	4 970 037,28 €
UDR 4.625% 01/2022	2 000 000	1 835 079,73 €
UDR INC 3.50 0727	4 887 000	4 052 276,72 €
UN TECH CO 3950 0825	8 265 000	7 272 765,79 €
UNIB 1125 0925	10 200 000	10 179 658,25 €
UNIB 2250 0538	12 800 000	12 619 056,81 €
UNIBAI 2125 250723	10 400 000	9 838 221,57 €
UNIBAIL-RODAM 2.5%24	3 300 000	3 650 715,32 €
UNIC 1000 0123	5 307 000	5 010 243,39 €
UNICREDIT 2.125% 26	2 700 000	2 632 252,58 €
UNICREDIT 4.375% 27	3 020 000	3 016 406,20 €
UNICREDIT 5.75%2025	500 000	519 712,40 €
UNICREDIT SPA 2% 23	6 160 000	6 276 774,69 €
UNICREDITO 3.25% 21	4 105 000	4 403 869,24 €



UNILEVER 0500 0125	2 600 000	2 557 863,71 €
UNILEVER N 0 20	635 000	635 012,70 €
UNILEVER N 0.375 223	9 600 000	9 624 268,73 €
UNILEVER NV	3 650 000	3 668 063,93 €
UNILEVER NV 1 0227	3 991 000	3 975 801,94 €
UNILEVER NV 1.375 30	4 250 000	4 172 882,13 €
UNION PA 3500 080623	975 000	859 337,83 €
UNION PAC 3.95 28	9 450 000	8 459 848,11 €
UNION PAC 4% 21	3 000 000	2 709 589,00 €
UNIQA INS.6.875% 43	2 000 000	2 306 567,12 €
UNIQA INSURANCE 6%46	1 000 000	1 115 051,37 €
UNIT 3650 0823	1 540 000	1 357 339,66 €
UNIT TECH 1.125% 21	1 780 000	1 810 466,86 €
UNITE 3850 0628	5 673 000	5 033 246,00 €
UNITED 2800 0524	2 005 000	1 659 457,18 €
UNITED PARC 1.625%25	3 500 000	3 624 944,42 €
UNITED PARCEL	2 590 000	2 574 268,08 €
UNITED TECH 3.35 21	520 000	459 208,75 €
UNITED TECH 1.15 24	773 000	768 633,46 €
UNITEDH 3500 150224	5 000 000	4 406 926,28 €
UNITEDHEALTH 3.10%26	1 125 000	958 535,63 €
UNITEDHEALTH 3.75%25	6 575 000	5 911 259,46 €
URENCO FIN. 2.25% 22	7 103 000	7 455 877,18 €
US AIR 3.95%13-2025	10 000 000	6 251 426,46 €
US BANCORP	1 545 000	1 281 010,41 €
US BANCORP 2.95 22	3 200 000	2 793 422,85 €
US BANCORP 3,95% 171	3 305 000	2 961 553,34 €
US BANCORP 3.10% 26	1 050 000	873 335,96 €
US BANK 3400 0723	2 775 000	2 461 552,73 €
US BK OHIO 3150 0421	5 815 000	5 116 337,78 €
USBK 0850 0624	3 500 000	3 490 656,44 €
UTD HEALTH 2.875% 23	1 500 000	1 299 757,25 €
VALE ENE PA 4.5 0328	3 800 000	3 313 776,84 €
VALEANT 6500 150322	3 535 000	3 169 857,37 €
VALEO SA	1 200 000	1 170 949,75 €
VALEO SA 0625 110123	1 800 000	1 759 245,69 €
VALEO SA 1625 0326	1 400 000	1 347 796,91 €
VALEOSA1,5%180625	7 100 000	6 865 035,31 €
VALERO 6.125%10-2020	3 950	3 641 578,00 €
VALERO ENE 3.65% 25	1 080 000	911 511,88 €
VALIDUS HLDGS	905 000	1 174 211,96 €
VENTAS REAL.4.125%26	1 197 000	1 051 808,19 €
VEOLIA 6.75%04-19	3 000 000	3 204 067,81 €
VEOLIA ENV 0 1120	2 000 000	1 998 794,60 €
VEOLIA ENVR 0.314 23	1 100 000	1 079 431,92 €
VEOLIA ENVRNMT	2 100 000	2 145 211,18 €
VEOLIA ENVRNMT	4 200 000	4 268 654,75 €
VERCOM INC 3125 0322	1 000 000	875 771,50 €
VEREIT 4625 1125	1 710 000	1 510 215,58 €
VERI COM 1.875 1029	3 000 000	2 957 622,36 €
VERISK ANAL 4% 25	6 375 000	5 607 312,03 €
VERIZON 3.376% 0225	7 926 000	6 817 277,53 €
VERIZON 4.125 27	5 339 000	4 735 255,69 €
VERIZON 4329 0928	5 373 000	4 815 926,38 €
VERIZON COM 0.875%25	4 500 000	4 447 223,27 €
VERIZON COM 1.375 26	3 410 000	3 389 516,62 €
VERIZON COM 2.875 38	1 850 000	1 905 002,53 €
VERIZON COMM 3% 2021	8 700 000	7 613 644,76 €
VERIZON COMM 5.15%23	11 700 000	11 058 580,24 €
VERIZON COMM INC	1 500 000	1 202 457,03 €
VERIZON LIBUS3M 0525	3 605 000	3 058 859,19 €
VESTEDA FI 1.75 19	2 279 000	2 307 968,28 €
VESTEDA FIN 2 26	1 450 000	1 440 201,09 €
VIACOM INC 3.875% 24	800 000	693 027,35 €

VIE GAS TRA 150 0928	1 900 000	1 905 266,59 €
VIER GAS TRANS 2%20	1 620 000	1 683 514,49 €
VINCI 1000 0925	3 800 000	3 789 421,29 €
VINCI 1750 0930	4 300 000	4 310 281,62 €
VISA INC 2.2% 20	6 500 000	5 624 867,45 €
VISA INC 2.80 122022	1 000 000	864 661,49 €
VISA INC 3.15% 12/25	1 500 000	1 290 267,03 €
VIVAT NV 2.375 05/24	2 100 000	2 161 209,80 €
VIVENDI 0.75%16-2021	2 100 000	2 132 114,76 €
VIVENDI 1.125%16-23	1 900 000	1 928 709,91 €
VMWARE I 2.95 210822	3 710 000	3 125 976,14 €
VODA Gp 3.1 0179	4 897 000	4 570 345,62 €
VODAF G 4.2 1078	2 500 000	2 302 978,25 €
VODAF GP 4375 0525	5 000 000	4 332 551,50 €
VODAF GP 4375 0528	11 750 000	10 024 738,57 €
VODAF GP 1.125 1125	4 330 000	4 205 156,85 €
VODAFONE 0.50% 24	2 150 000	2 086 060,80 €
VODAFONE 2.95% 2023	4 175 000	3 546 314,19 €
VOLK 0625 0921	2 300 000	2 285 189,90 €
VOLK BK 1.25 1225	8 568 000	7 976 426,60 €
VOLKS 1250 0624	6 700 000	6 516 296,95 €
VOLKS 1375 0125	8 988 000	8 755 990,86 €
VOLKS 3375 0624	5 200 000	4 936 716,16 €
VOLKS BK 0.75 0623	5 233 000	5 059 122,51 €
VOLKS BK E3M 0621	1 300 000	1 274 924,91 €
VOLKS GR 4.25 1123	4 000 000	3 485 571,54 €
VOLKS IF 3.30% 2033	2 900 000	2 929 469,93 €
VOLKS LEAS 2.625% 24	200 000	212 605,02 €
VOLKS WI A 2.75 1027	5 400 000	5 224 151,59 €
VOLKSW 3250 181130	2 700 000	2 721 771,92 €
VOLKSW 4125 161138	2 500 000	2 595 156,15 €
VOLKSW F 1.875 0327	17 200 000	16 503 566,70 €
VOLKSW LEASING 1.625	4 765 000	4 620 191,54 €
VOLKSWA 1.125 1023	3 600 000	3 528 085,46 €
VOLKSWAGEN 0.75%20	1 900 000	1 913 784,60 €
VOLKSWAGEN 0.875 23	6 129 000	5 990 015,20 €
VOLKSWAGEN 1127	4 800 000	4 785 781,22 €
VOLKSWAGEN 1375 1023	3 176 000	3 149 090,15 €
VOLKSWAGEN 2.125% 22	3 300 000	3 448 473,45 €
VOLKSWAGEN 4.625% 26	1 500 000	1 529 575,52 €
VOLKSWAGEN PERP	2 400 000	2 201 139,29 €
VOLKSWAGEN PERPET	5 600 000	5 278 024,92 €
VOLVO 4200 10/06/75	5 000 000	5 238 595,89 €
VOLVO CAR 3.25% 21	1 550 000	1 620 420,38 €
VOLVO T AB 2.375% 17	3 967 000	4 059 401,76 €
VONOVIA BV	4 200 000	4 136 669,71 €
VONOVIA BV 075 0124	2 300 000	2 236 856,32 €
VONOVIA BV 1.5 0326	5 500 000	5 390 010,02 €
VONOVIA FI 1.50 26	2 000 000	1 941 438,50 €
VONOVIA FIN 2.25% 23	3 500 000	3 638 011,77 €
VOYA FIN 3.125 0724	2 000 000	1 671 772,44 €
VOYA FIN 3650 0626	2 869 000	2 381 547,33 €
VWAGEN 0250 0221	2 259 000	2 242 224,68 €
VWAGEN LEASING 1% 16	1 800 000	1 769 322,81 €
VWFI 0250 1020	1 100 000	1 096 139,44 €
WABTEC 4700 150928	4 100 000	3 422 747,92 €
WAL MART 3.40 23	5 255 000	4 641 404,62 €
WALBOOTS3.3%11/2021	1 600 000	1 397 059,00 €
WALG BOOT 3.8%11/24	1 260 000	1 091 063,12 €
WAL-MART 3.30% 2024	1 500 000	1 322 908,19 €
WALMT 3550 0625	9 000 000	7 958 170,41 €
WALMT 3700 0628	9 705 000	8 602 268,21 €
WASTE MAN 2.4 0523	2 545 000	2 136 094,65 €
WELL BK 3550 08/23	6 808 000	5 999 109,33 €

WELLS 2625 0722	2 275 000	1 939 445,87 €
WELLS 1500 0527	300 000	297 339,23 €
WELLS 2400 0120	1 000 000	877 024,01 €
WELLS FAR 1.625% 25	4 289 000	4 392 801,17 €
WELLS FAR 1375 1026	1 700 000	1 671 008,74 €
WELLS FAR 3.5% 03/22	13 035 000	11 458 468,62 €
WELLS FAR 430 0727	1 375 000	1 202 336,32 €
WELLS FAR 5.875% 25	2 305 000	1 989 172,76 €
WELLS FARG 3000 0426	4 500 000	3 677 575,12 €
WELLS FARGO 1.125%21	5 373 000	5 494 271,01 €
WELLS FARGO 1.5%22	3 600 000	3 716 154,85 €
WELLS FARGO 2.25% 23	7 459 000	7 999 685,64 €
WELLS FARGO 3% 2026	4 370 000	3 554 806,96 €
WELLS FARGO 4.10% 26	2 425 000	2 070 560,88 €
WELLS FARGO 4.6%2021	4 000	3 625 370,44 €
WELLS FARGO 7.98% 18	3 289 000	2 856 972,65 €
WELLS FBK 3.32 21	4 540 000	4 020 203,57 €
WELLTOWER 4 0625	7 000 000	6 041 839,56 €
WENDEL SA 1% 0423	2 700 000	2 654 338,93 €
WESFARMERS 2.75% 22	6 250 000	6 842 001,50 €
WEST 1650 0519	9 165 000	7 995 526,82 €
WEST 4750 0226	2 110 000	1 628 544,44 €
WESTERN GA 5.375% 21	1 610 000	1 457 834,51 €
WESTERN GAS 4%2022	800 000	688 198,21 €
WESTERN GAS PART	1 060 000	888 475,00 €
WESTERN UN 4250 0623	9 360 000	8 259 000,13 €
WESTLA CH 3.6 150826	9 795 000	7 986 890,04 €
WESTPA LIBUS3M 0520	995 000	870 986,83 €
WESTPAC 0375 050323	1 000 000	991 281,49 €
WESTPAC 0750 171023	3 100 000	3 101 320,10 €
WESTPAC B 4.875 19	3 535 000	3 160 451,52 €
WESTPAC BANK 2.85%26	3 375 000	2 758 186,26 €
WESTPAC BANKING	10 000 000	9 825 082,78 €
WESTROCK 3% 09/24	2 748 000	2 280 829,18 €
WESTROCK 4000 0328	3 000 000	2 528 224,64 €
WESTROCK CO	4 632 000	4 138 856,00 €
WHI POFIN 1.10 1127	3 500 000	3 237 874,27 €
WILL PART 5.25% 2020	1 141	1 031 765,83 €
WILLIAMS COS 4.55%24	11 831 000	10 417 857,09 €
WILLIAMS PAR 3.9%25	1 800 000	1 554 299,96 €
WILLIAMS PARTNE.4%25	5 225 000	4 483 494,73 €
WILLOW NO.2 3.375%22	5 430 000	6 054 389,69 €
WLLS FRG CO 3.069 23	6 650 000	5 732 354,97 €
WOLTERS 1500 0327	2 547 000	2 600 558,62 €
WOODSIDE FIN.3.70%26	2 800 000	2 319 384,16 €
WORLDPAY FIN 3.75%22	2 000 000	2 119 080,00 €
WPCEU 2250 0426	1 500 000	1 485 992,06 €
WPP 1375 0325	10 184 000	9 967 457,47 €
WPP FINAN 0.75% 19	5 590 000	5 625 916,90 €
WPP FINANC 3.625%22	3 100 000	2 659 767,06 €
WPP FINANCE 1.625%30	8 200 000	7 480 205,45 €
WYNDHAM WORLDWID	3 475 000	2 956 584,66 €
XEROX 2.75% 19	2 840 000	2 495 766,61 €
XLIT 3250 0647	1 600 000	1 576 580,84 €
XLIT LTD 4.45 25	560 000	489 661,79 €
YOR BLD S 0.875 0323	1 150 000	1 112 786,78 €
YORKSHRE BLD 1.25%22	3 550 000	3 555 003,73 €
ZAPA 1750 0328	1 096 000	1 118 324,62 €
ZIMMER BIO 2.425%26	2 650 000	2 713 708,93 €
ZIMMER BIOM 1.414%22	2 000 000	2 032 989,67 €
ZOETIS 3.25%13-2023	6 000 000	5 219 799,09 €
ZUERCH KBK 2.625%27	2 000 000	2 048 574,79 €
ZURICH 7.50%09-2039	175	9 372 415,07 €

## TITRE DE CREANCE NEGOCIABLE

Encours sous gestion dans la poche

695 222 760 €

Libellé des valeurs	Quantité de titres	Valeur des titres au 31/12/2018
CR07 -0.0% 18/10/18	8 500 000	8 520 533,79 €
CR07 -0.2% 22/10/18	5 000 000	5 003 126,26 €
CR07 -0.2% 24/05/18	21 000 000	21 024 913,38 €
CR07 -0.2% 28/12/18	9 000 000	9 017 880,20 €
CR07 -0.3% 18/10/18	12 100 000	12 107 227,39 €
CR07 31/10/18	9 000 000	9 009 533,09 €
CR07 31/10/18	8 450 000	8 457 532,48 €
CR15 0.00% 13/12/18	26 400 000	22 837 027,28 €
CR15 0.00% 29/11/18	25 450 000	22 232 762,23 €
CR16 0.00% 08/11/18	25 300 000	21 940 391,49 €
CR16 0.00% 12/07/18	92 300 000	80 696 176,22 €
CR16 -0.2% 08/01/18	1 300 000	1 300 065,57 €
CR16 -0.2% 15/10/18	500 000	500 433,20 €
CR16 -0.3% 09/02/18	4 500 000	4 501 431,76 €
CR16 -0.3% 09/07/18	25 000 000	25 001 994,60 €
CR16 -0.3% 10/10/18	4 000 000	4 003 919,84 €
CR16 -0.3% 12/12/18	7 500 000	7 497 902,39 €
CR16 -0.3% 14/09/18	2 500 000	2 501 784,01 €
CR16 -0.3% 15/10/18	17 000 000	17 004 415,85 €
CR16 -0.3% 15/10/18	20 000 000	20 002 353,37 €
CR16 -0.3% 24/05/18	500 000	500 593,18 €
CR16 -0.3% 28/09/18	38 000 000	38 032 726,75 €
CR16 -0.4% 07/09/18	700 000	700 340,61 €
CR16 -0.4% 25/07/18	1 500 000	1 500 358,44 €
CR16 14/02/18	1 500 000	1 500 552,25 €
CR17 -0.3% 10/07/18	27 000 000	27 042 690,31 €
CR31 0.00% 09/08/18	25 400 000	22 165 019,86 €
CR31 0.00% 13/09/18	25 100 000	21 851 679,57 €
CR31 0.00% 16/08/18	25 500 000	22 241 758,87 €
CR31 0.00% 19/07/18	50 950 000	44 524 433,85 €
CR31 0.00% 24/05/18	25 325 000	21 940 456,38 €
CR31 0.00% 26/07/18	25 750 000	22 492 067,75 €
CR36 -0.2% 09/03/18	20 000 000	20 006 503,99 €
CR36 -0.2% 23/03/18	25 000 000	25 017 100,93 €
CR36 -0.2% 23/03/18	25 000 000	25 016 673,63 €
CR36 -0.2% 27/03/18	25 000 000	25 016 673,63 €
CR36 -0.3% 14/09/18	20 000 000	20 008 057,17 €
CR36 -0.3% 27/03/18	20 000 000	19 993 593,92 €
CR36 -0.3% 28/03/18	10 000 000	10 006 917,53 €
T-NOTE 2.875 28	10 050 000	9 026 394,99 €
T-NOTE 3125 1128	5 387 000	4 910 132,32 €
US TREASURY NB 2,875	4 800 000	4 282 693,43 €
USA 2750 1120	2 830 000	2 493 101,99 €
USA 2875 0923	2 000 000	1 790 834,68 €

## ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIFS

Encours sous gestion dans la poche

7 637 439 609 €

Libellé des fonds	Quantité de titres	Valeur des titres au 31/12/2018
ACADIAN GLBL EQTY	508 000,00	9 123 680,00 €
AMUNDI 3M I2	57 536,32	572 815 261,60 €
AMUNDI CASH INSTITUT	4 977,32	49 542 052,76 €
ASHMORE EM MA TR	554 347,37	50 680 001,80 €
AVIVA I EMERG. MARKT	75 257,92	97 214 532,48 €
AXA CT SICAV	7,45	75 119,02 €
AXA WORLD FUNDS	1 266 437,53	252 988 387,18 €
BLACKROCK GLOBAL FD	12 253 585,30	254 150 817,88 €

BNP PARIBAS AQUA I	265,00	9 649 381,40 €
BNP PARIBAS INVEST3M	175,91	176 310 975,70 €
BNPP MOIS	169,92	3 911 807,51 €
BNY MELLON GL-EMM	82 016 643,84	110 453 241,65 €
BRSF SIC	1 269 742,25	120 704 098,60 €
COMGEST EMERG 3DEC	8 804 644,00	274 887 586,37 €
DIMENSIONAL EMERG	12 292 702,08	256 056 984,31 €
FIDELITY FDS EMERG	24 907 495,98	274 099 024,13 €
FIDELITY FUNDS HIGH	17 056 382,34	187 401 620,25 €
FIRST STATE WORLDW	3 340 000,00	6 182 340,00 €
FISHER EMERG MRKTS	1 751 021,23	205 254 708,35 €
FRANK TEMP INV EMKT	18 803 140,54	435 721 640,12 €
GAM MULTIBD	1 651 177,54	459 582 442,97 €
GROUPAMA CASH 4DEC	4 074,65	164 046 990,06 €
HSBC GIF GL	2 439 467,52	82 282 280,12 €
JANUS HANDE GL C FU	7 900 000,00	15 049 500,00 €
JANUS HEND GL C FUND	356 279,53	41 572 957,04 €
JUPITER ECOLOGY CL.I	1 780 000,00	7 399 231,24 €
KBI INST WATER H	775 000,00	14 025 950,00 €
MULTI UNITS FRA LYXO	275 000,00	8 741 342,50 €
MULTIPART ROBECO	526 000,00	12 697 640,00 €
NEUBER BERGMAN	4 380 970,44	85 959 993,77 €
PARVEST ENVIRT OPPO	104 000,00	18 851 040,00 €
PICTET CLEAN ENERG	265 500,00	19 179 720,00 €
PICTET FUND LUX	1 279 147,61	208 776 941,30 €
PICTET FUNDS LUX -EM	243 515,28	90 815 233,98 €
PICTET WATER CL.I	29 900,00	9 428 367,00 €
PIMCO EMERGING	18 479 870,00	197 707 046,41 €
QUONIAM-EM MKT EQUIT	219 608,41	245 772 550,37 €
SCHRODER INTL FUND	904 860,08	126 352 551,30 €
SCHRODER SICAV	1 045 000,00	17 442 304,00 €
SCHRODERS INTL EMERG	25 911 840,38	441 434 112,71 €
SPARINVEST ETHICAL	39 750,00	6 556 762,50 €
STONE HARBOR-EM MKLC	2 955 487,13	312 987 160,22 €
TOBAM A/B EM MK EQ-A	23 525,91	208 101 058,37 €
UNION + SI.3DEC	7 809,00	1 488 192 131,73 €
VONTOBEL NEW POWER I	76 000,00	7 261 040,00 €

### FONDS D'ACTIFS NON-COTES

<b>Engagement global de la poche</b>	<b>1 276 239 192 €</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**

**Engagement global de la poche** 600 000 000 €

**Libellé des fonds**

FCP BNPP AM FRR DETT  
 FCT SPG DETTE PRIVE  
 FPS IDINVEST FRR  
 LYXOR FRR DETTE PRIV

**FONDS DE CAPITAL INVESTISSEMENT - FONDS DEDIES**

**Engagement global de la poche** 585 000 000 €

**Libellé des fonds**

FPS ARD FF FRR A  
 FPS LGT FOF FRR CI  
 SWEN FDS DE FDS A  
 FCP IDINVEST INNOV F  
 FCP OMNES INNOV FRR  
 TRUFFLE INNOV FRR FR