

FRR PORTFOLIO COMPOSITION AS OF DECEMBRE 31, 2011

EQUITIES

Total (€)	5 852 055 618 €
------------------	------------------------

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
361 DEGREES INTL	124 000	38 004 €
3M	28 061	1 766 620 €
A2A	688 985	500 548 €
AAC TECHNOLOGIES	184 000	318 280 €
AALBERTS INDUST,	87 449	1 135 088 €
AAREAL BANK	110 249	1 541 832 €
ABACUS PROPERTY	65 014	97 557 €
ABBOTT LABO,	251 161	10 878 742 €
ABCAM	698 400	3 051 790 €
ABERCROMBIE CL,A	3 457	130 057 €
ABERDEEN ASSET	1 350 000	3 426 314 €
ABERTIS INFRAES,A	170 851	2 108 301 €
ACADIA REALTY TRUST	15 025	233 095 €
ACCENTURE PLC-CL	244 317	10 017 712 €
ACCIONA	11 179	745 975 €
ACCOR	100 332	1 965 002 €
ACCORDIA GOLF	1 405	779 305 €
ACE NOM,	13 168	711 246 €
ACERGY	197 943	2 836 043 €
ACERINOX	110 081	1 090 903 €
ACRUX LIMITED	32 487	73 636 €
ACS ACT,CONSTR,	103 656	2 373 722 €
ACTELION	115 159	3 059 459 €
ACTIVISION	574 543	5 452 449 €
ADELAIDE BRIGHTON	95 139	217 147 €
ADIDAS NOM,	92 028	4 625 327 €
ADMIRAL GROUP	755 834	7 709 453 €
ADOBE SYSTEMS	227 132	4 946 096 €
ADP (PROMESSE)	13 050	691 650 €
ADVANCE AUTO PARTS	56 470	3 028 814 €
ADVANCED MICRO ORD	26 835	111 623 €
AED OIL LTD	34 369	12 708 €
AEGON	838 947	2 601 575 €
AEON	100 400	1 062 503 €
AEON MALL	34 151	558 698 €
AES	31 578	288 001 €
AETNA	15 206	494 177 €
AF AB-B	184 372	2 299 652 €
AFFINE	1 569	19 613 €
AFLAC	18 175	605 647 €
AGGREKO	62 542	1 510 202 €
AGILE PROPERTY	801 771	553 483 €
AGILENT TECHN,	13 587	365 578 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
AGL ENERGY	92 392	1 045 631 €
AGNICO EAGLE MINES	87 877	2 463 096 €
AGREE REALTY	3 589	67 401 €
AGRIUM	6 266	324 144 €
AIA GROUP LTD	1 834 569	4 412 559 €
AIMS AMP	86 400	48 505 €
AIR FRANCE	66 065	262 476 €
AIR LIQUIDE	89 659	8 570 504 €
AIR LIQUIDE PRIME	98 290	9 395 541 €
AIR N,ZEALAND	56 516	30 566 €
AIR PRODUCTS	8 345	547 613 €
AIR WATER	55 000	539 648 €
AIRGAS	2 275	136 829 €
AISIN SEIKI	297 600	6 537 189 €
AIXTRON AG	104 900	1 033 265 €
AJ LUCAS GROUP	9 957	8 100 €
AJ LUCAS GROUP DS	4 978	- €
AJINOMOTO CO	175 000	1 618 943 €
AJISEN CHINA	86 000	72 931 €
AKAMAI TECHN,	7 202	179 079 €
AKZO NOBEL	101 562	3 794 356 €
ALCATEL A	1 010 882	1 220 135 €
ALCOA	41 521	276 657 €
ALESCO CORP	14 840	13 537 €
ALEXANDER S	761	216 910 €
ALEXANDRIA REAL	24 760	1 315 435 €
ALEXION PHARMA, INC	7 406	407 895 €
ALIBABA,COM	303 500	241 724 €
ALIM,COUCHE SUB,	4 900	117 510 €
ALLEGHENY TECHN,	146 914	5 409 405 €
ALLERGAN	191 136	12 918 096 €
ALLIANCE DATA SYS,	2 024	161 895 €
ALLIANT ENERGY	4 886	166 016 €
ALLIANZ	200 119	14 790 795 €
ALLIED PROPERTIES	23 119	442 144 €
ALLREAL HOLDING	2 568	288 765 €
ALLSTATE	20 859	440 414 €
ALPHA BANK	233 308	125 520 €
ALPHA NAT,RES,	8 804	138 550 €
ALSTOM REGROUPT	128 924	3 020 689 €
ALSTRIA OFF,REIT	26 865	247 051 €
ALTERA	12 661	361 826 €
ALTRIA GROUP	172 516	3 940 147 €
ALUMINA	486 760	428 635 €
AMADEUS IT HOLDING	361 589	4 532 518 €
AMAZON COM	84 734	11 298 302 €
AMCOR	248 633	1 415 767 €
AMDOCS	8 985	197 460 €
AMEC	237 000	2 574 853 €
AMER,ELECT,POWER	19 734	627 955 €
AMER,TOWER CL,A	84 337	3 898 524 €
AMEREN	9 469	241 648 €
AMERICAN ASSETS TR	14 720	232 558 €
AMERICAN CAMPUS	29 034	938 428 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
AMERICAN EAGLE	8 730	102 821 €
AMERICAN EXPRESS	194 225	7 057 151 €
AMERICAN INTL GRP	17 321	309 542 €
AMERICAN WATER WKS	6 000	147 250 €
AMERIPRISE FCIAL	8 785	335 917 €
AMERISOURCEBERGEN	113 560	3 253 194 €
AMETEK INC	6 451	209 203 €
AMGEN	313 621	15 511 943 €
AMLIN	343 749	1 291 785 €
AMP	579 759	1 863 544 €
AMP NZ OFFICE	147 842	72 850 €
AMPELLA MINING	39 347	46 146 €
AMPHENOL CL,A	6 394	223 559 €
AMVIG	76 000	31 057 €
ANADARKO PETROLE,	19 536	1 148 654 €
ANALOG DEVICES	175 748	4 843 833 €
ANDRITZ AG	191 271	12 260 471 €
ANGLO IRISH BANK	1 655 585	- €
ANNALY CAP,MGMT	668 433	8 217 679 €
ANRITSU	372 000	3 158 350 €
ANSELL	28 012	321 667 €
ANTA SPORTS	200 000	183 095 €
ANXIN-CHINA HOLDIN	416 000	60 241 €
AON	132 236	4 767 097 €
AP MOELLER MAERS,A	448	2 160 314 €
APA GROUP ST,SECU,	130 965	464 408 €
APAC RESOURCES	1 040 000	34 040 €
APACHE	15 261	1 064 814 €
APARTMENT INVEST,A	45 111	796 097 €
APERAM	26 118	284 686 €
APN NEWS AND MEDIA	35 892	20 126 €
APOLLO GROUP CL,A	5 528	229 389 €
APOLLO SOLAR ENERG	1 406 000	39 744 €
APPLE	209 873	65 474 168 €
APPLIED MATERIALS	53 274	439 504 €
APR ENERGY PLC	48 592	581 149 €
AQUARIUS PLATINUM	500 000	937 986 €
AQUILLA RESOURCES	35 196	162 610 €
ARA ASSET MNGMT	74 800	54 435 €
ARAFURA RESOURCES	71 625	20 647 €
ARB CORP	14 173	86 524 €
ARC RESOURCES	10 800	205 076 €
ARCADIS	125 000	1 512 500 €
ARCELORMITTAL	513 901	7 225 448 €
ARCH CAPITAL GROUP	133 747	3 835 619 €
ARCHER DANIELS	26 306	579 534 €
ARDENT LEISURE GROUP	61 793	49 778 €
ARISTOCRAT LEISURE	106 385	184 842 €
ARKEMA	60 016	3 282 875 €
ARROW ELECTRON,ORD	4 121	118 754 €
ARTIS REAL	39 122	414 054 €
ARYZTA	117 564	4 404 022 €
ASAHI GLASS	456 000	2 949 299 €
ASAHI KASEI	1 005 000	4 668 803 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
ASCENDAS INDIA TR	115 000	47 140 €
ASCENDAS REAL EST	1 263 620	1 373 745 €
ASCIANO UNIT	195 914	696 267 €
ASCOTT RESID,REIT	167 000	98 218 €
ASHFORD HOSPITALI,	25 329	156 087 €
ASHLAND	3 114	137 110 €
ASIA STANDARD INTL	110 000	13 092 €
ASM PACIFIC TECHN,	40 700	351 809 €
ASML HOLDING	189 690	6 160 183 €
ASPEN GR	117 296	39 370 €
ASSICURAZ,GEN,ORD,	681 084	7 921 007 €
ASSOCIATED BRITISH	323 939	4 293 074 €
ASSOCIATED ESTATES	15 474	190 117 €
ASSURANT	4 002	126 577 €
ASSYSTEM	73 800	874 530 €
ASTELLAS PHARMACEUTI	335 700	10 520 034 €
ASTON RESOURCES	11 998	86 228 €
ASTRAZENECA	409 075	14 569 593 €
ASTRO JAPAN UNIT	13 967	23 164 €
ASX	35 386	854 607 €
AT AND T	590 470	13 754 285 €
ATLANTIA	203 744	2 520 313 €
ATLAS IRON	178 878	381 433 €
ATOS ORIGIN	26 984	915 027 €
AUCKLAND INTL ARPT	204 216	309 251 €
AURORA OIL & GAS	81 310	217 691 €
AUS,NZL BKG GROUP	532 048	8 626 556 €
AUSDRILL LTD	59 696	141 437 €
AUSENCO	18 268	35 636 €
AUSTAL	28 204	47 890 €
AUSTAR UTD CIONS	125 614	118 551 €
AUSTIN	17 949	55 993 €
AUSTRALAND PROP,	57 825	109 604 €
AUSTRALIAN AGRIC	56 193	59 024 €
AUSTRALIAN PHARM,	83 049	17 381 €
AUSTRALIAN WLD,	104 205	107 398 €
AUSTRIAMICROSYSTEM	134 084	4 241 557 €
AUTODESK INC	9 183	214 544 €
AUTOGRILL	56 715	427 631 €
AUTOLIV	120 567	4 967 747 €
AUTOM,DATA PROCES,	223 160	9 284 295 €
AUTOMOTIVE HOLDINGS	47 255	64 564 €
AUTONATION	3 921	111 360 €
AUTOZONE	22 552	5 645 296 €
AVAGO TECHNOLOGIES	9 876	219 551 €
AVALONBAY COMMUN,	39 337	3 957 335 €
AVERY DENNISON	4 032	89 075 €
AVEVA GROUP PLC	261 100	4 469 927 €
AVIVA	10 695	38 514 €
AVNET	202 684	4 853 987 €
AVON PRODUCTS	16 670	224 330 €
AXA	1 020 333	10 249 245 €
AXEL SPRINGER	177 476	5 893 091 €
AXFOOD	116 755	3 327 123 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
AXIS CAPITAL	4 992	122 897 €
AXIS COM	221 500	3 447 209 €
AZ ELECT,MATERIALS	265 361	762 440 €
BABCOCK & WILCOX	4 336	80 628 €
BABCOCK INTL GRP	668 237	5 883 974 €
BAE SYSTEMS	500 307	1 707 620 €
BAKER HUGHES ORD,	16 805	629 637 €
BALL	7 254	199 538 €
BALOISE HOLDING	100 120	5 311 581 €
BANCO BILBAO VIZC,	2 155 283	14 397 290 €
BANCO POP,ESPAÑOL	460 703	1 621 675 €
BANCO POPOLARE	769 362	769 362 €
BANCO SABADELL	4 201 896	12 328 363 €
BANK AMERICA	401 641	1 720 169 €
BANK N,Y, MELLON	48 532	744 317 €
BANK NOVA SCOTIA	60 350	2 320 680 €
BANK OF EAST ASIA	420 240	1 225 433 €
BANK OF MONTREAL	25 471	1 076 763 €
BANK OF YOKOHAMA	962 000	3 505 887 €
BANK QUEENSLAND	45 224	261 086 €
BANK SARASIN	132 767	3 002 269 €
BANKIA	3 442 265	12 374 943 €
BANKINTER	156 395	742 876 €
BARCO	46 861	1 816 332 €
BARD (C,R,)	85 117	5 605 842 €
BARRICK GOLD	246 496	8 605 962 €
BARRY CALLEBAUT N,	18 403	14 030 790 €
BASF SE	405 651	21 860 532 €
BASWARE	27 362	450 105 €
BATHURST RESOURCES	142 712	68 752 €
BAWANG INTL	176 000	17 806 €
BAXTER INTL	96 076	3 661 871 €
BAYER	395 691	19 547 135 €
BB AND T	27 753	538 086 €
BCA CARIGE CASSA	313 926	464 610 €
BCA MONTE PASCHI	2 360 899	594 710 €
BCE	263 805	8 475 847 €
BCO ESP,CREDITO	35 870	133 616 €
BCO ESPIRITO SANTO	320 894	433 207 €
BCO SANT,CENT,HISP	3 708 920	21 771 360 €
BCP BCO NOM,	2 382 414	324 008 €
BEACH PETROLEUM	218 631	213 244 €
BEADELL RESOURCES	123 175	58 368 €
BEAM	6 038	238 274 €
BECHTLE	98 842	2 589 660 €
BECTON DICKINSON	125 232	7 207 930 €
BED BATH BEYOND	135 836	6 065 639 €
BEFIMMO SCA SICAFI	6 315	317 518 €
BEIERSDORF NOM,	165 836	7 266 934 €
BEKAERT NV PS	19 532	484 101 €
BELGACOM	655 646	15 892 859 €
BELIMO HOLDING	4 063	5 673 272 €
BELL ALIANT	84 174	1 820 581 €
BELLE INTL HOLD,	1 283 000	1 723 019 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
BEMIS CO	4 519	104 708 €
BEND,AND ADEL,BANK	74 643	473 372 €
BENI STABILI	358 492	123 967 €
BERKELEY UNIT	139 049	2 124 105 €
BERKLEY	125 211	3 316 905 €
BERKSHIRE HATHAW,A	28	2 475 073 €
BERKSHIRE HATHAWAY B	287 272	16 884 035 €
BEST BUY	14 348	258 291 €
BESUNYEN HOLDINGS	132 000	15 318 €
BETSSON	120 400	2 049 667 €
BG GROUP	189 865	3 128 806 €
BGP HOLDINGS	3 056 274	- €
BHP BILLITON	650 136	17 673 102 €
BIC	153 494	10 514 339 €
BIG YELLOW	48 738	143 127 €
BILFINGER BERGER	15 060	992 153 €
BILLABONG INTL	49 350	68 986 €
BIOGEN IDEC	58 349	4 946 316 €
BIOMED REALTY TR,	53 845	749 898 €
BIOMERIEUX	8 710	481 140 €
BIOSENSORS INTL GR	254 000	215 779 €
BIOTA HOLDINGS	38 500	24 325 €
BLACKROCK	49 971	6 860 908 €
BLACKSTONE GROUP	364 587	3 934 574 €
BLOCK (H,AND R,)	12 253	154 130 €
BLUESCOPE STEEL	708 802	226 714 €
BMC SOFTWARE	107 247	2 708 024 €
BML	14 600	266 039 €
BMW	132 367	6 851 316 €
BNP PARIBAS	458 072	13 902 485 €
BOARDWALK REAL	18 047	688 649 €
BOART LONGYEAR	92 239	202 515 €
BOC HKG HOLD,	860 500	1 570 411 €
BOEING	33 135	1 872 171 €
BOLLORE INVEST,	2 255	341 633 €
BOMBARDIER CV CL,A	9 865	30 300 €
BOMBARDIER CV CL,B	64 500	198 109 €
BORAL (NEW)	148 830	423 146 €
BORG WARNER	98 188	4 820 908 €
BOSHIWA INTL	122 000	21 176 €
BOSIDENG	468 000	102 121 €
BOSTON PROPERTIES	61 871	4 746 843 €
BOSTON SCIENTIFIC	61 196	251 723 €
BOUYGUES	103 392	2 517 078 €
BP	2 104 555	11 602 389 €
BQUE,NAT,GRECE NOM	416 828	675 261 €
BRADKEN	35 109	197 977 €
BRAMBLES	299 947	1 696 115 €
BRAMMER	636 293	1 832 018 €
BRANDYWINE RLTY PB	50 595	370 245 €
BRE PROPERTIES INC	30 131	1 171 632 €
BRENNTAG	44 999	3 237 678 €
BRIDGESTONE	1 020 750	17 833 488 €
BRIGHTOIL PETRO HLD	406 000	60 806 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
BRISA NOM,ESC,	197 523	502 696 €
BRISTOL MYERS ORD,	397 168	10 781 236 €
BRIT,AMER,TOBACCO	404 656	14 802 184 €
BRITISH LAND	348 784	1 931 194 €
BRITISH SKY BROAD,	700 181	6 140 100 €
BROADCOM CL,A	19 112	432 236 €
BROADRIDGE FINL	5 126	89 040 €
BROCKMAN RESOURCES	18 054	29 087 €
BROOKFIELD ASSET	24 757	525 163 €
BROOKFIELD PROP,	163 215	1 971 891 €
BROWN AND BROWN	5 226	91 099 €
BROWN FORMAN CL,B	3 435	213 027 €
BUCHER INDUSTRIES	10 733	1 451 815 €
BUNGE	6 207	273 487 €
BUNNINGS WAREHOUSE	296 077	402 190 €
BUNZL	247 800	2 622 473 €
BUREAU VERITAS	24 184	1 361 559 €
BUZZI UNICEM ORD,	35 462	239 723 €
BYD ELECTRONIC INTL	181 000	39 675 €
C,P, POKPHAND	1 534 000	144 542 €
CA	265 953	4 141 303 €
CA IMMOBILIEN ANL,	33 048	273 869 €
CABCHARGE AUSTRAL,	23 853	84 395 €
CABLEVISION NY A	9 722	106 491 €
CABOT OIL GAS	4 000	233 862 €
CACHE LOGISTIC	93 000	52 486 €
CAFE DE CORAL HOLD	84 000	148 301 €
CALLOWAY REAL ESTATE	38 782	785 410 €
CALPINE	14 600	183 653 €
CALSONIC KANSEI	136 000	597 757 €
CALTEX AUSTRALIA	26 992	250 905 €
CAMBRIDGE INDUST	227 520	64 202 €
CAMDEN PROPERTY PB	27 922	1 338 673 €
CAMECO	15 753	219 399 €
CAMERON INTL	328 040	12 429 739 €
CAMPBELL BROTHERS	13 768	532 692 €
CAMPBELL SOUP	215 892	5 527 846 €
CAMPUS CREST CMNTI	11 330	87 798 €
CAN,NAT,RAILWAY	18 097	1 097 306 €
CANADIAN APARTMENT	28 987	489 239 €
CANADIAN IMBK COMM	15 819	883 068 €
CANADIAN NATU,RES,	43 283	1 249 194 €
CANADIAN OIL SANDS	18 700	328 914 €
CANADIAN PACIFIC	6 968	363 779 €
CANADIAN REAL EST,	25 231	675 703 €
CANADIAN TIRE CL,A	3 072	153 153 €
CANADIAN UTILITIES	3 617	168 393 €
CANON	605 500	20 672 357 €
CAP GEMINI	68 364	1 650 649 €
CAP&COUNTRY PROPERTY	257 779	569 688 €
CAPCOM	69 900	1 272 309 €
CAPITA GROUP	1 400 950	10 541 088 €
CAPITACOMM,REIT	1 238 515	776 233 €
CAPITAL ONE FCIAL	130 018	4 235 450 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
CAPITALAND	1 828 747	2 400 957 €
CAPITAMALL TRST FD	1 455 923	1 470 367 €
CAPITAMALLS ASIA	889 240	596 947 €
CAPITARETAIL	117 000	79 932 €
CAPLEASE	24 958	77 669 €
CARBON ENERGY	143 370	10 530 €
CARDINAL HEALTH	376 724	11 784 595 €
CARDNO LTD	24 714	101 300 €
CAREFUSION CORP	132 607	2 595 551 €
CARGOTEC B	130 385	2 996 247 €
CARMAX	8 603	201 987 €
CARNARVON PETROLEUM	137 125	10 505 €
CARREFOUR	298 603	5 259 892 €
CARSALES,COM,AU	46 004	173 305 €
CASINO GUICHARD	19 273	1 254 287 €
CASTELLUM	64 857	621 656 €
CATERPILLAR	25 827	1 802 439 €
CATHAY PAC,AIRWAYS	321 000	424 086 €
CBL ASSOCIAT,PROP,	55 957	676 725 €
CBRE GP A	12 404	145 424 €
CBS CL,B	421 569	8 813 267 €
CC LAND HOLDINGS	259 000	36 992 €
CDL HOSPITAL TRUSTS	416 762	382 521 €
CEDAR SHOPPING	24 934	82 780 €
CELANESE SER,A	5 910	201 537 €
CELESIO NOM,	37 615	460 408 €
CELGENE	64 178	3 341 883 €
Cenovus Energy	29 954	766 610 €
CENTERPOINT ENERGY	15 937	246 629 €
CENTERRA GOLD	60 605	825 275 €
CENTRAL GLASS	228 000	849 179 €
CENTRICA	4 045 834	14 012 448 €
CENTRO RETAIL AUST	45 909	62 181 €
CENTURYTEL	273 408	7 834 523 €
CERNER	7 166	338 097 €
CF INDUSTRIES	2 589	289 134 €
CFG LTD	61 800	33 409 €
CFS RETAIL PROP,	1 280 620	1 704 189 €
CH OFFSHORE PTE	78 000	16 218 €
CH ROBINSON WORLD,	56 607	3 042 703 €
CHALLENGER DIV	134 759	51 618 €
CHALLENGER FCIAL	110 843	361 540 €
CHAMPION REIT	1 420 522	411 411 €
CHAODA MODERN	670 000	73 099 €
CHARTER CIONS CL A	4 300	188 601 €
CHARTER HALL GROUP	48 196	75 746 €
CHARTER HALL OFFICE	283 303	785 337 €
CHARTER HALL REIT	175 932	444 624 €
CHARTWELL SENIORS	53 603	344 688 €
CHECK POINT SOFTW,	8 680	351 292 €
CHEMRING GROUP	550 000	2 633 126 €
CHEN HSONG HOLD,	28 000	6 693 €
CHESAPEAKE ENERGY	25 499	437 816 €
CHESAPEAKE LODGING	11 963	142 465 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
CHEUNG KONG	96 000	433 239 €
CHEUNG KONG HOLD,	352 000	3 225 963 €
CHEVRONTEXACO	402 726	33 007 277 €
CHIBA BANK	182 000	903 805 €
CHIGO HOLDINGS LTD	606 000	11 300 €
CHIHU-TIANDE GROUP	146 000	59 372 €
CHIN,DONGXIANG GRP	568 000	74 365 €
CHINA AEROSPACE	466 000	26 345 €
CHINA AUTOMATION	154 000	34 368 €
CHINA DAYE NON-FERRO	846 000	38 599 €
CHINA FOR GREEN RES	87 700	6 263 €
CHINA GAS HOLDINGS	648 000	229 450 €
CHINA GREEN	135 000	27 449 €
CHINA HIGH PRECIS,	152 000	40 479 €
CHINA HIGH SPEED	267 000	90 040 €
CHINA HUIYUAN	118 500	31 029 €
CHINA ITS HLDGS	123 000	13 054 €
CHINA LIANSU GROUP	176 000	58 828 €
CHINA LILANG	70 000	47 142 €
CHINA LUMENA NEW M	426 000	60 844 €
CHINA MEDICAL SYSTEM	128 000	65 763 €
CHINA MENGNIU	268 000	482 720 €
CHINA METAL RECYCLIN	106 200	88 481 €
CHINA MILK PRODUCTS	239 000	43 336 €
CHINA MINING	1 654 000	18 538 €
CHINA NICKEL	232 000	14 037 €
CHINA OIL AND GAS	760 000	48 997 €
CHINA OIL RESOURCE	808 000	15 547 €
CHINA OVS LAND INV	1 577 773	2 031 252 €
CHINA PRECIOUS MET	488 000	69 699 €
CHINA RARE EARTH	246 000	37 575 €
CHINA RESOURCES LD	867 860	1 074 259 €
CHINA RESSOURCES	2 000 000	59 511 €
CHINA RONG HEAVY	408 000	86 600 €
CHINA SCE PROPERTY	279 000	43 999 €
CHINA SHANSHUI CEM	421 000	215 882 €
CHINA SHINeway PHA	49 000	53 558 €
CHINA SINGYES SOLAR	72 000	21 352 €
CHINA SOUTH CITY	362 000	35 905 €
CHINA TONTINE WINE	296 000	27 304 €
CHINA TRAVEL INTL	570 000	74 061 €
CHINA VANADIUM TIT	203 000	30 604 €
CHINA WATER AFF,	312 000	66 843 €
CHINA WINDPOWER GROU	740 000	21 285 €
CHINA WIRELESS	316 000	43 879 €
CHINA XLX FERTILISER	59 000	11 216 €
CHINA YURUN FOOD	275 000	278 213 €
CHINA ZHONGWANG HOL	324 800	85 692 €
CHINESE ESTATES	76 500	94 845 €
CHIPOTLE MEXICAN A	1 313	341 590 €
CHIYODA	288 000	2 257 749 €
CHOCOL,LINDT SPRUN	259	6 697 430 €
CHOCOLAD,LINDT BP	318	731 932 €
CHORUS	77 465	145 238 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
CHOW SANG INTL	41 000	71 165 €
CHOW TAI FOOK JEWL	221 400	305 676 €
CHR, HANSEN HOLD,	631 483	10 611 946 €
CHRISTIAN DIOR	31 821	2 915 122 €
CHUBB	23 085	1 230 892 €
CHUBU ELECTRIC POW	97 000	1 395 565 €
CHUO MITSUI TRUST	428 480	969 528 €
CHURCH AND DWIGHT	73 267	2 582 574 €
CI FINANCIAL	8 400	134 085 €
CIGNA	11 521	372 733 €
CIMAREX ENERGY	3 441	164 072 €
CIMENTS FRANCAIS	4 716	282 017 €
CIMPOR CIMENTOS	854 682	4 544 344 €
CINCINNATI FCIAL	6 341	148 781 €
CINEWORLD GROUP	305 984	751 864 €
CINTAS	6 139	164 611 €
CINTRA CONCESIONES	242 050	2 257 116 €
CISCO SYSTEMS	616 699	8 588 752 €
CIT GROUP	7 744	208 006 €
CITIC 21 CN CO	546 000	23 287 €
CITIC TELECOM INTL	187 000	29 676 €
CITIGROUP	395 130	8 007 911 €
CITIZEN HOLDINGS	225 700	1 010 091 €
CITRIX SYSTEMS	103 228	4 828 227 €
CITY DEVELOPMENTS	409 763	2 166 513 €
CITY NATIONAL	2 077	70 684 €
CITY TELECOM (H,K,	68 000	27 383 €
CITYCON	108 035	249 561 €
CITYSPRING INFRA	225 000	44 778 €
CLIFFS NATURAL	69 622	3 343 808 €
CLOROX	27 149	1 391 956 €
CLOSE BROTHERS GRP	178 661	1 325 039 €
CLOUGH LTD	77 988	42 499 €
CLP HOLDINGS	369 000	2 417 374 €
CLS HOLDINGS	8 218	58 046 €
CME GROUP	2 689	504 721 €
CNA FINANCIAL	2 173	44 776 €
CNA HONGXING SPRT	449 000	27 618 €
CNH GLOBAL	2 300	63 763 €
CNP ASSURANCES	183 313	1 755 772 €
COACH	85 263	4 008 977 €
COAL OF AFRICCA LTD	93 061	61 002 €
COALSPUR MINES LTD	83 386	100 759 €
COASTAL GREENLAND	36 000	1 035 €
COCA COLA HBC	64 941	860 468 €
COCA-COLA	527 459	28 428 829 €
COCA-COLA AMATIL	114 816	1 043 699 €
COCA-COLA ENTREPRISE	299 783	5 953 170 €
COCHLEAR	11 323	554 435 €
COCKATOO COAL NPV	149 014	44 132 €
COFFEY INTL	19 954	6 698 €
COFINIMMO	5 148	467 541 €
COGNIZANT TECHN,A	11 738	581 475 €
COLGATE PALMOLIVE	67 492	4 803 255 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
COLONIA REAL EST,	6 936	20 801 €
COLONIAL PROP,PB	38 304	615 484 €
COLOPLAST B	97 414	10 826 108 €
COLRUYT	311 856	9 121 788 €
COMBA TELECOM	87 353	54 237 €
COMCAST CL,A	921 254	16 825 553 €
COMCAST CL,A SPL	26 837	487 043 €
COMERICA	8 129	161 553 €
COMFORTDELGRO	418 000	351 375 €
COMINAR REAL ESTATE	23 623	393 702 €
COMM,BANCSHARES	3 211	94 287 €
COMMERZBANK	1 686 185	2 197 099 €
COMMONWEALTH REIT	30 943	396 620 €
COMPASS GROUP	1 255 167	9 181 217 €
COMPUTER SCIENCES	6 040	110 267 €
COMPUTERSHARE	111 206	703 491 €
COMW,BK AUSTRALIA	319 224	12 408 944 €
COMW,PROP,UNIT	1 420 522	1 071 394 €
CONAGRA FOODS	328 773	6 685 878 €
CONCHO RESOURCES	3 928	283 662 €
CONOCOPHILLIPS	68 424	3 840 746 €
CONS,MEDIA HOLD,	48 776	100 156 €
CONSOL ENERGY INC,	8 688	245 609 €
CONSOL,EDISON	185 890	8 882 111 €
CONST,AUX,FERROC,	10 766	4 144 910 €
CONSTEL,ENERGY GRP	8 060	246 295 €
CONSTELLATION CL,A	7 709	122 743 €
CONTACT ENERGY	71 142	225 298 €
CONTINENTAL	35 297	1 697 609 €
CONTINENTAL RES,	2 055	105 599 €
CONWERT IMMO,INV,	210 471	1 800 369 €
COOPER INDUSTRIES	6 405	267 163 €
CORIO	76 798	2 580 797 €
CORNING	62 791	627 813 €
CORP,FINANC,ALBA	13 286	401 636 €
CORPORATE OFF,PB	27 027	442 608 €
COSCO	179 000	93 046 €
COSTCO WHOLESALE	17 200	1 103 916 €
COUNTRY GARDEN	1 924 802	555 551 €
COUSINS PROPERTIES	38 822	191 688 €
COVENTRY HEALTH	6 101	142 726 €
COVIDIEN	294 981	10 227 311 €
CREDIT AGRICOLE	438 626	1 912 409 €
CREDIT SAISON	281 800	4 353 398 €
CREE	4 900	83 189 €
CRESCENT POINT ENE	11 289	383 460 €
CRITERIA CAIXACORP	3 165 611	12 013 494 €
CRODA INTL	549 618	11 870 117 €
CROMBIE REIT	13 161	139 590 €
CROWN	112 785	720 605 €
CROWN CASTLE INTL	70 886	2 446 228 €
CSE GLOBAL	103 000	45 892 €
CSL	106 801	2 699 125 €
CSR	100 927	156 229 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
CST MINING GROUP	3 920 000	24 495 €
CSX	42 391	687 686 €
CTS EVENTIM	167 748	3 891 754 €
CUDECO LTD	27 698	80 937 €
CUMMINS	7 860	532 920 €
CUSTOMERS LTD	27 791	21 729 €
CVS CAREMARK	240 466	7 553 692 €
CYBERAGENT	965	2 416 365 €
D R HORTON	12 827	124 594 €
DAEJAN HOLDINGS	1 782	59 201 €
DAH SING BANKING	74 000	48 662 €
DAH SING FINANCIAL	29 500	68 028 €
DAICEL CHEM,IND,	58 000	272 347 €
DAIHEN CORP	266 000	716 400 €
DAIICHI SANKYO	109 900	1 679 089 €
DAIMLERCHRYSLER	466 473	15 822 764 €
DAINIPPON SCREEN	104 000	675 771 €
DAIWA HOUSE IND,	457 000	4 200 300 €
DANAHER	270 423	9 798 720 €
DAPHNE INTER	166 000	142 419 €
DARDEN RESTAURANTS	5 428	190 578 €
DART ENERGY	154 855	44 028 €
DASSAULT SYSTEMES	47 133	2 918 947 €
DAVID JONES	102 106	191 116 €
DAVIDE CAMPARI	410 514	2 112 095 €
DAVITA	45 115	2 634 546 €
DBS GROUP HOLDINGS	356 500	2 439 779 €
DCM JAPAN HOLDINGS	123 200	748 722 €
DCT INDUSTRIAL	92 204	363 645 €
DECHRA PHARMACEUT	455 000	2 827 068 €
DEEP YELLOW	153 921	15 803 €
DEERE	94 700	5 642 463 €
DEJIN RESOURCES	1 204 000	7 882 €
DELHAIZE GROUP PS	63 955	2 775 967 €
DELL	71 264	803 106 €
DELTA AIR LINES	35 414	220 690 €
DELTICOM	52 000	3 468 400 €
DENA	49 300	1 139 705 €
DENBURY RESOURCES	14 370	167 145 €
DENSO	299 500	6 375 020 €
DENTSPLY INTL	5 673	152 903 €
DERWENT LONDON	291 363	5 441 473 €
DEU,LUFTHANSA NOM,	99 878	917 379 €
DEUTSCHE BANK NOM,	409 317	12 048 246 €
DEUTSCHE BORSE PR OF	85 536	3 465 063 €
DEUTSCHE EUROSHOP	135 174	3 352 315 €
DEUTSCHE POST NOM,	397 229	4 719 081 €
DEUTSCHE TELEKOM	2 561 036	22 703 584 €
DEUTSCHE WOHN,POR,	228 134	2 341 796 €
DEVELOPERS DIVERS RE	104 462	979 281 €
DEVELOPMENT SECU,	56 610	101 658 €
DEVON ENERGY	15 892	758 977 €
DEVRO	900 000	2 777 685 €
DEXIA	258 668	76 824 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
DEXUS PTY,UNIT	2 918 338	1 912 984 €
DIA	296 400	1 035 918 €
DIAGEO	820 907	13 822 647 €
DIALOG SEMICOND,	227 877	2 866 009 €
DIAMOND OFFSHORE	16 816	715 800 €
DIAMONDROCK	62 862	466 792 €
DIASORIN	216 791	4 225 257 €
DIC ASSET	12 653	67 820 €
DICKSON PROV,REGPT	53 000	21 237 €
DIGITAL CHINA	168 000	200 623 €
DIGITAL REALTY TRUST	44 490	2 284 816 €
DIGNITY	832 424	8 181 732 €
DIRECTV - CLASS A	160 787	5 295 988 €
DISCO	27 000	1 085 352 €
DISCOVER FINANCIAL	491 322	9 083 137 €
DISCOVERY COM CL A	5 447	171 902 €
DISCOVERY COM CL C	5 870	170 466 €
DISCOVERY METALS	85 377	88 330 €
DISH NETWORK CORP	8 615	188 996 €
DISNEY WALT-DISNEY	71 688	2 070 790 €
DOLLAR GENERAL	6 354	201 358 €
DOLLAR TREE	27 713	1 774 170 €
DOMINION RESOURCES	117 302	4 796 172 €
DOMINO PRINTING	1 896 188	11 622 749 €
DOMINO'S PIZZA UK	1 316 703	6 344 702 €
DONGYUE GROUP	205 000	104 104 €
DONNELLEY AND SONS	8 383	93 180 €
DOUGLAS EMMETT	35 148	493 837 €
DOVER	7 993	357 413 €
DOW CHEMICAL	45 756	1 013 667 €
DOWA HOLDINGS	336 000	1 638 286 €
DOWNER EDI	85 271	215 501 €
DR PEPPER SNAPPLE	8 662	263 423 €
DRAEGERWERK	78 454	3 916 424 €
DST SYSTEMS	1 980	69 427 €
DSV	291 139	4 034 675 €
DTE ENERGY	22 302	935 406 €
DU PONT DE NEMOURS	36 942	1 302 731 €
DUFREY GROUP-REG	54 906	3 910 226 €
DUKE ENERGY	407 904	6 912 562 €
DUKE REALTY	105 761	981 682 €
DULUX GROUP	71 864	164 024 €
DUN BRADSTREET	13 038	751 528 €
DUNDEE REAL ESTATE	26 418	652 930 €
DUNELM GROUP	1 331 942	6 917 233 €
DUPONT FABRS TCHNL	22 890	427 050 €
E,ON	1 000 039	16 670 650 €
EAST JAPAN RAILWAY	73 800	3 620 545 €
EASTGROUP PROPERTIES	10 074	337 404 €
EASTMAN CHEMICAL	5 958	179 263 €
EATON ORD,	156 307	5 241 137 €
EBARA	380 000	1 008 210 €
EBAY	362 993	8 480 648 €
ECHO ENTERTAINMENT	137 225	389 068 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
ECOLAB	142 488	6 345 117 €
EDENRED	198 801	3 781 195 €
EDF	114 070	2 144 516 €
EDISON INTL	166 318	5 303 933 €
EDISON ORD,	223 038	182 891 €
EDP ENERG,PORTUGAL	2 115 542	5 058 261 €
EDP RENOVAVEIS	116 539	550 996 €
EDUCATION REALTY	26 948	212 354 €
EDWARDS LIFESCIEN,	36 750	2 001 406 €
EFG EUROBK ERGAS,	184 982	70 108 €
EIFFAGE	29 804	557 484 €
EL PASO	30 600	626 284 €
ELAN	257 068	2 755 769 €
ELDERS	90 386	18 560 €
ELDORADO GOLD	311 343	3 302 212 €
ELECTRIC POWER	145 200	2 975 815 €
ELECTRONIC ARTS A	13 303	211 094 €
ELEKTA S,B	423 154	14 193 416 €
ELEMENTIS	414 284	680 471 €
ELI LILLY ORD	320 404	10 257 272 €
ELISA CORP,S,A	96 144	1 550 803 €
ELRINGKLINGER	219 147	4 203 239 €
EMC	730 591	12 122 115 €
EMECO HOLDINGS	126 238	96 209 €
EMERSON ELECTRIC	29 204	1 048 078 €
EMPEROR WATCH & JE	580 000	55 801 €
ENAGAS	79 348	1 133 883 €
ENBRIDGE	313 267	9 027 000 €
ENCANA	29 465	421 072 €
ENDESA	36 956	585 753 €
ENEL ENERG,ELET,	4 339 314	13 642 803 €
ENEL GREEN POWER	5 167 867	8 175 566 €
ENERG,RES,A AUD0,2	41 498	40 148 €
ENERGIZER HOLDINGS	2 677	159 770 €
ENI	1 811 684	29 005 061 €
ENN ENERGY	164 000	405 031 €
ENTERGY	7 254	408 184 €
ENTERTAINMENT PROP	17 525	590 061 €
ENVESTRA UNIT	208 117	117 520 €
EOG RESOURCES	104 600	7 937 256 €
EPURE SOUND GLOBAL	134 000	39 803 €
EQUATORIAL RESOURC	23 195	30 592 €
EQUIFAX	5 505	164 276 €
EQUITABLE CORP	5 996	253 059 €
EQUITY LIFESTYLE	14 690	754 642 €
EQUITY ONE	21 518	281 448 €
EQUITY RESIDENTIAL	125 205	5 500 263 €
ERAMET	4 711	445 190 €
ERIE INDEMNITY C,A	1 142	68 756 €
ERSTE BANK OSTERR,	123 670	1 680 057 €
ESPRIT HOLDINGS	256 203	254 622 €
ESSEX PROPERTY TRUST	13 040	1 411 378 €
ESSILOR INTL	354 553	19 340 866 €
ESUN HOLDINGS	190 000	20 730 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
EULER HERMES	75 774	3 466 661 €
EUR,AERO,DEFENCE	143 543	3 466 563 €
EURAZEO	14 127	388 422 €
EUROBK PROPERTIES	6 528	24 806 €
EUROCOMM, PROPRTS	15 362	376 830 €
EUROFINS SCIENT,	14 511	817 405 €
EUROMONEY INST INV	104 599	782 645 €
EUTELSAT COMM,PROM	407 353	12 281 693 €
EVA PRECISION IND	240 000	44 752 €
EVEREST REINS,GRP	41 978	2 719 096 €
EVERGRANDE	1 242 000	396 663 €
EVOLUTION MINING	105 484	124 961 €
EVS BROADCAST EQ,	57 493	2 270 399 €
EWG LTD	269 187	145 627 €
EXELIS INC	18 455	128 653 €
EXELON	26 433	883 068 €
EXOR ORD,	34 451	535 713 €
EXPEDIA	52 020	1 162 857 €
EXPEDITORS INTL	8 288	261 498 €
EXPERIAN	220 535	2 311 486 €
EXPRESS SCRIPTS	130 087	4 478 191 €
EXTENDICARE REAL	29 914	192 358 €
EXTRA SPACE STORAGE	35 346	659 709 €
EXTRACT RESOURCES	19 409	129 986 €
EXXON MOBIL	800 786	52 283 640 €
EZION HOLDINGS	105 000	41 169 €
EZRA HOLDINGS	124 400	62 078 €
F&C COMMERCIAL	191 358	232 754 €
F5 NETWORKS	3 078	251 608 €
FAIRFAX FCIAL VTG	7 070	2 337 376 €
FAIRFAX MEDIA	141 299	80 347 €
FAIVELEY	18 500	889 850 €
FAMILY DOLLAR STO,	27 738	1 231 993 €
FANTASIA HOLDINGS	381 000	25 697 €
FANUC	12 700	1 497 857 €
FAR EAST CONSORT,	53 000	5 782 €
FAST RETAILING	42 200	5 915 098 €
FASTENAL	12 132	407 546 €
FAURECIA	24 077	352 728 €
FDAL REALTY INV,	26 937	1 883 017 €
FEDEX	12 258	788 527 €
FELCOR LODGING TRUST	46 362	108 923 €
FENNER PLC	1 480 839	7 101 929 €
FERROTEC	89 400	645 348 €
FIAT INDUSTRIAL	360 589	2 388 902 €
FIAT ORD,	344 797	1 224 029 €
FIDELITY NATIONAL	234 950	4 812 294 €
FIDESEA GROUP	90 950	1 647 400 €
FIELMANN	50 595	3 715 697 €
FIFTH THIRD BCP	291 416	2 855 347 €
FILTRONA	499 421	2 274 389 €
FINMECCANICA	188 762	539 482 €
FINNING INTL	7 005	117 699 €
FIRST CAPITAL	24 473	320 296 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
FIRST IND,REALTY	32 465	255 829 €
FIRST PACIFIC	594 000	476 039 €
FIRST POTOMAC REALIT	18 673	187 708 €
FIRST RESOURCES LTD	92 000	82 528 €
FIRST SHIP LEASE	94 000	15 915 €
FIRST SOLAR	2 549	66 287 €
FIRSTENERGY	16 654	568 304 €
FISERV	92 624	4 190 983 €
FISHER PAYKEL APPL	143 400	31 022 €
FISHER PAYKEL HEA,	112 224	169 944 €
FISHER PLC	435 000	2 650 724 €
FKP PROPERTY	502 373	190 443 €
FLEETWOOD CORP	12 320	116 662 €
FLETCHER BUILDING	137 920	508 881 €
FLEXIGROUP LIMITED	40 399	59 504 €
FLEXTRONICS INTL	30 248	131 878 €
FLIGHT CENTRE	14 829	188 788 €
FLINDERS MINES	355 747	78 668 €
FLOWSERVE	69 041	5 282 046 €
FLUOR	7 203	278 810 €
FMC TECHNOLOGIES	9 572	385 107 €
FOMENTO CONSTR,	22 746	455 830 €
FONC,DES REGIONS	22 487	1 115 355 €
FOOK WOO GROUP HOL	360 000	48 918 €
FOOT LOCKER	6 394	117 419 €
FORD MOTOR	148 060	1 227 180 €
FOREST CITY ENT,A	65 454	595 953 €
FOREST LAB,CL,A	105 643	2 462 454 €
FORTESCUE METALS	250 736	845 556 €
FORTIS	1 144 601	1 373 521 €
FORTIS	8 484	214 178 €
FORTUM	648 128	10 687 631 €
FORTUNE BRANDS	6 038	79 207 €
FORTUNE REAL EST,	249 000	92 861 €
FOSSIL	2 400	146 714 €
FOSTER WHEELER AG	4 994	73 629 €
FOSUN INTL	386 000	155 438 €
FOXCONN INTL HOLD,	428 000	212 680 €
FP	45 000	2 250 451 €
FRANCE TELECOM	1 731 813	21 015 551 €
FRANCO NEVADA	128 725	3 776 492 €
FRANKLIN RESOURCES	6 258	463 059 €
FRANKLIN STREET	30 569	234 295 €
FRAPORT AG	16 009	608 342 €
FRASER & NEAVE	285 000	1 049 724 €
FRASERS CENTREPOINT	79 000	67 582 €
FRASERS COMM TRUST	123 600	54 336 €
FREEPORT MCMORAN	37 014	1 048 949 €
FREIGHTWAYS	30 384	67 191 €
FRESENIUS	56 224	4 018 892 €
FRESENIUS MED,CARE	369 137	19 379 693 €
FRIGOGLASS NOM,	391 542	1 413 467 €
FRONTIER COMM, B	105 975	420 406 €
FST QUANTUM MINE,	18 475	280 231 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
FU JI FOOD CATER,	72 000	54 274 €
FUCHS PETROLUB PF	276 193	9 340 847 €
FUFENG GROUP	168 000	59 320 €
FUGRO	197 229	8 854 596 €
FUJI ELECTRIC HOLD	630 000	1 330 897 €
FUJI HEAVY IND,	458 000	2 132 259 €
FUJI SEAL INTL	67 800	943 552 €
FUJI TV NETWORK	2 595	3 032 003 €
FUJIFILM HOLDINGS	191 800	3 500 715 €
FUJITSU	2 474 000	9 907 889 €
FURUKAWA ELECTRIC	172 000	304 806 €
FUSHAN ENERGY	538 000	140 340 €
G RESSOURCES GROUP	3 357 000	146 504 €
G,U,D,HOLDINGS	14 535	80 929 €
G4S	165 053	537 069 €
GAGFAH	33 532	133 256 €
GALAXY	249 000	351 685 €
GALAXY RESOURCES L	62 954	35 052 €
GALENICA NOM,	7 100	3 213 980 €
GALLAGHER	4 035	103 937 €
GALLANT VENTURE LTD	189 000	26 947 €
GALP ENERGIA CL,B	146 137	1 663 039 €
GAMELOFT	309 900	1 499 916 €
GAMESTOP CL,A	5 596	104 014 €
GANNETT	10 284	105 914 €
GAP	15 446	220 708 €
GARMIN	5 961	182 797 €
GAS NATURAL SDG	174 127	2 309 795 €
GATEGROUP HOLDING	173 882	3 258 766 €
GCL POLY ENERGY HOLD	1 555 000	334 684 €
GDF SUEZ	803 201	16 963 605 €
GEA GROUP	380 075	8 304 639 €
GECINA NOM,	15 282	993 330 €
GEELY AUTOMOBILE	825 000	139 107 €
GEMALTO	38 916	1 462 463 €
GEN,PROPERTY TRUST	1 046 880	2 538 242 €
GENERAL ELECTRIC	1 382 147	19 068 135 €
GENERAL GROWTH PRO	193 692	2 240 990 €
GENERAL MILLS	276 454	8 605 381 €
GENERAL MOTORS	25 748	402 027 €
GENTEX	5 432	123 812 €
GENTING SINGAPORE	1 242 000	1 114 133 €
GENUINE PARTS	14 869	700 957 €
GENUS PLC	264 766	3 306 009 €
GENWORTH FCIAL C,A	20 054	101 181 €
GEODYNAMICS	54 691	6 695 €
GEOPHYSIQUE(GLE)	65 717	1 191 449 €
GEORGE WESTON	1 978	101 889 €
GERRESHEIMER	79 899	2 572 348 €
GESTEVISION TELEC,	70 236	309 741 €
GETINGE B	113 700	2 228 184 €
GETTY REALTY CORP	9 339	100 354 €
GFK	135 000	4 135 050 €
GILEAD SCIENCES	76 959	2 426 384 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
GINDALBIE METALS	170 075	70 518 €
GIORDANO INTL	300 000	167 523 €
GIVAUDAN NOM,	20 161	14 864 565 €
GJENSIDIGE FORSIKR	746 002	6 673 027 €
GKN (NEW)	764 202	1 674 236 €
GLANBIA	233 391	1 079 433 €
GLAXOSMITHKLINE	849 937	14 972 852 €
GLIMCHER REALITY	52 836	374 435 €
GLOBAL BIO CHEM	489 600	76 726 €
GLOBAL LOGISTIC PR	693 897	723 453 €
GLOBEOP FINANCIAL S	341 600	1 165 521 €
GLORIOUS PROPERTY	609 000	82 149 €
GLORY LTD	129 200	2 143 416 €
GMG GLOBAL	1 126 000	74 920 €
GOLDCORP	231 870	7 930 433 €
GOLDEN AGRI-RESOURCE	1 823 132	774 395 €
GOLDEN EAGLE	116 000	188 919 €
GOLDEN MEDITECH	344 000	29 343 €
GOLDMAN SACHS	19 613	1 366 202 €
GOME ELEC,APPL,	2 605 760	465 213 €
GOODMAN FIELDER	390 662	134 211 €
GOODMAN GRP UNIT	4 456 735	2 006 270 €
GOODMAN PROPETY T,	156 855	93 787 €
GOODPACK	73 000	59 847 €
GOODTOP TIN	420 000	37 908 €
GOOGLE CL,A	64 588	32 134 794 €
GOVERNMENT PRO,SBI	13 207	229 408 €
GPE BRUXEL,LAMBERT	199 168	10 259 144 €
GPE EUROTUN,REGPT	239 525	1 259 902 €
GRAINCORP	39 683	246 021 €
GRAINGER	116 095	148 715 €
GRAINGER (W,W,)	2 977	429 259 €
GREAT EAGLE HOLD,	62 000	93 718 €
GREAT PORTL,ESTAT,	117 867	455 777 €
GREAT-WEST LIFECO	11 184	172 602 €
GREE INC	77 700	2 063 080 €
GREEK ORG,FOOTBALL	177 237	1 210 529 €
GREEN MTN COFFEE	6 000	207 287 €
GREENTOWN CHINA HLD	131 500	43 954 €
GRENKELEASING	33 545	1 308 255 €
GRIFOLS	175 475	2 281 175 €
GROUPE CGI CL,A	9 441	137 131 €
GROUPE DANONE	382 359	18 571 177 €
GRUPO CATAL,OCC,	86 456	1 060 815 €
GRYPHON MINERALS	63 528	57 196 €
GS YUASA	426 000	1 765 759 €
GSW IMMOBILIEN	137 717	3 084 861 €
GUNNS LIMITED	161 123	15 906 €
GUOCO GRP	26 000	186 318 €
GUOCOLAND	47 333	49 490 €
GUOCOLEISURE	134 000	47 365 €
GWA GROUP LTD	60 241	101 813 €
GZI REIT	161 000	54 773 €
HAIER ELECTRONICS GP	145 000	99 953 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
HAITIAN INTL HLD	128 000	84 807 €
HALLIBURTON	240 497	6 393 122 €
HALMA	1 218 093	4 818 124 €
HAMAMATSU	33 300	897 846 €
HAMBURGER HAFEN LO	12 674	289 284 €
HAMMERSON	661 319	2 850 172 €
HANG LUNG GROUP	204 000	860 943 €
HANG LUNG PROPERT,	1 278 072	2 801 511 €
HANG SENG BANK	153 900	1 406 626 €
HANKYU HANSHIN	637 000	2 066 360 €
HANNOVER RUCK,NOM,	135 678	5 199 859 €
HANSEN NATURAL	2 400	170 340 €
HANSTEEN HOLDINGS	239 413	219 264 €
HARGREAVES LANSDOWN	798 791	4 116 839 €
HARLEY-DAVIDSON	156 802	4 694 880 €
HARMAN INTL IND,	2 734	80 112 €
HARRIS	188 308	5 227 716 €
HARTFORD FINANCIAL	19 013	237 992 €
HARVEY NORMAN	166 248	240 930 €
HASBRO	5 358	131 618 €
HASEKO	1 361 000	694 944 €
HASTIE	21 384	9 542 €
HCA HOLDINGS	163 973	2 782 564 €
HCP	172 548	5 506 597 €
HEALTH CARE REIT	159 560	6 702 208 €
HEALTH CARE RLTY T	34 863	499 232 €
HEIDELBERGCEMENT	82 404	2 702 027 €
HEINEKEN	182 695	6 535 000 €
HEINEKEN HOLDING	50 879	1 608 794 €
HEINZ	99 594	4 145 786 €
HELICAL BAR	43 839	97 749 €
HELLENIC PETROLEUM	40 228	256 252 €
HELLENIC TELECOM,	160 595	462 514 €
HENDERSON INVEST,	438 000	24 762 €
HENDERSON LAND	701 990	2 687 589 €
HENG TAI	703 500	27 911 €
HENGAN INTL GROUP CO	186 000	1 340 273 €
HENGDELI HLDGS	300 000	75 579 €
HENKEL PF	78 158	3 485 065 €
HENKEL POR	56 798	2 124 245 €
HENNES MAURITZ S,B	177 699	4 418 863 €
HERBALIFE	4 300	171 145 €
HERMES INTL	18 586	4 281 285 €
HERSHA CL,A SBI	63 353	238 147 €
HERSHEY FOODS	142 351	6 774 337 €
HESS	13 240	579 288 €
HEWLETT PACKARD	78 653	1 560 700 €
HI SUN TECH CHINA	399 000	83 898 €
HIDILI INDUSTRY	207 000	47 427 €
HIGHWOODS PROP,	26 998	617 032 €
HIKMA PHARMACEUT,	360 500	2 675 805 €
HILLS INDUSTRIES	49 347	43 844 €
HI-P INTERNATIONAL	68 000	24 440 €
HITACHI	1 614 000	6 528 394 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
HITACHI CHEMICAL	46 000	624 509 €
HITACHI HIGH-TECH,	186 100	3 111 604 €
HITACHI METALS	471 000	3 947 006 €
HITACHI TRANSPORT	279 300	3 696 782 €
HKC HOLDINGS	819 870	23 176 €
HKG AND CHINA GAS	1 201 030	2 144 228 €
HKG EXCHANGES	216 200	2 661 167 €
HKG LAND HOLD,	1 027 910	3 594 755 €
HKG SHANGHAI HOT,	147 000	125 535 €
HKR INTERNATIONAL	136 000	32 779 €
HO BEE INVESTMENT	61 000	37 144 €
HOCHTIEF	25 168	1 124 884 €
HOGANAS S,B	33 169	792 019 €
HOLLYFRONTIER	8 000	144 200 €
HOLOGIC	300 800	4 057 162 €
HOMBURG CDA	18 070	218 724 €
HOME DEPOT	136 164	4 409 440 €
HOME PROPERTIES	18 235	808 650 €
HONDA MOTOR	930 400	21 872 038 €
HONEYWELL INTL	163 747	6 855 376 €
HONG KONG AIRCRAFT	10 000	99 185 €
HONG KONG CHINESE	138 000	18 341 €
HONG LEONG ASIA	24 000	22 313 €
HONGKONG ELECTRIC	323 000	1 840 506 €
HOPEWELL HOLDINGS	132 000	260 015 €
HOPEWELLE HIGHWAY	178 600	68 909 €
HOPSON DEVELOPMENT	403 787	161 399 €
HORIZON OIL LTD	226 356	35 754 €
HORMEL FOODS	153 477	3 462 749 €
HOSPIRA	34 196	799 979 €
HOSPITALIT,PROP,PB	51 858	917 961 €
HOST HOTELS	296 605	3 374 562 €
HOTEL PROPERTIES	41 000	42 259 €
HR REAL ESTATE	64 506	1 135 083 €
HSBC HOLDINGS	1 766 514	10 384 852 €
HUABAO INTERNATIONAL	251 000	98 835 €
HUBER SUHNER	37 590	1 223 169 €
HUDSON CITY	22 131	106 547 €
HUFVUDSTADEN LIB,A	802 516	6 316 929 €
HUGO BOSS ORD	27 800	1 508 428 €
HUGO BOSS PF	7 535	428 742 €
HUMAN GENOME SCCE	7 953	45 272 €
HUMANA	113 920	7 687 977 €
HUNT TRANSPORT SCE	3 996	138 730 €
HUNTING	528 820	4 748 174 €
HUNTINGTON BANCSH,	35 118	148 512 €
HUSKY ENERGY	10 934	203 071 €
HUTCH,HARBOUR RING	722 000	47 263 €
HUTCH,WHAMPOA ORD	647 000	4 174 421 €
HUTCHINSON TELEC	291 000	86 300 €
HYFLUX	129 000	92 345 €
HYSAN DEVELOPMENT	454 557	1 149 670 €
I,T LIMITED	94 000	39 904 €
IAC INTERACTIVE CORP	62 864	2 062 861 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
IAMGOLD	80 701	987 814 €
IBERDROLA	1 959 175	9 480 448 €
IBM	101 567	14 386 181 €
ICADE	29 736	1 807 651 €
IFI PRIV,	21 812	306 677 €
IGM FINANCIAL	5 077	169 880 €
IHI	1 200 000	2 246 696 €
IHS CL,A	59 043	3 918 614 €
IINET	30 435	68 744 €
ILIAD	9 540	909 639 €
ILLINOIS TOOL WRK	19 770	711 336 €
ILLUMINA	4 574	107 391 €
ILUKA RESOURCES	84 948	1 039 878 €
IMDEX	38 530	56 295 €
IMERYS	90 249	3 211 962 €
IMI	366 476	3 334 392 €
IMMOAEST NV	1 227 354	- €
IMMOB COLONIAL NV	12 271	28 101 €
IMMOBILIARE GRANDE	855 882	632 925 €
IMMOFINANZ	480 511	1 114 786 €
IMMOFINANZ DA10	720 883	- €
IMPERIAL TOBACCO	342 127	9 973 414 €
IMTECH	343 753	6 880 216 €
INBEV	463 172	21 910 351 €
INCITEC PIVOT	331 151	813 363 €
INDEPENDENCE GROUP	43 766	130 655 €
INDESIT COMPANY	419 500	1 558 023 €
INDITEX	246 289	15 585 168 €
INDOFOOD AGRI RES,	93 000	69 890 €
INDOPHIL RESOURCES	179 342	58 780 €
INDRA SISTEMAS	364 317	3 583 786 €
INDUSTREA LTD	72 064	55 775 €
INFIGEN ENERGY	161 203	34 374 €
INFINEON TECHN,	472 712	2 749 293 €
INFORMA	154 694	669 112 €
INFRATIL	89 400	100 999 €
ING GROEP	1 697 018	9 435 420 €
ING OFFICE FUND	1 574 094	745 898 €
ING UK REAL ESTATE	230 074	102 601 €
INGENICO	82 526	2 302 475 €
INGERSOLL-RAND	12 913	303 081 €
INGRAM MICRO INC-A	162 800	2 281 106 €
INLAND REAL ESTATE	33 193	194 576 €
INNVEST REIT/OPER TR	34 723	108 489 €
INPEX HOLDINGS	1 100	5 341 410 €
INSPUR INTL	570 000	11 590 €
INSUR,AUSTRAL,GRP	419 772	987 933 €
INTACT FINANCIAL	5 015	222 058 €
INTEGRA MINING LTD	197 115	83 286 €
INTEL	201 494	3 763 850 €
INTER PARFUMS	51 000	835 380 €
INTERCHINA HLDGS	520 000	21 404 €
INTERCONTINENTALEX	2 890	268 364 €
INTERPUBLIC GROUP	19 086	143 049 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
INTERROLL HOLD,NOM	7 177	1 646 589 €
INTERTEK GROUP	220 715	5 377 170 €
INTERVEST OFFICES	2 520	45 738 €
INTESA SANPAOLO	5 108 785	6 610 768 €
INTIME DEPARTMENT	156 000	123 009 €
INTL FLAVORS	3 127	126 265 €
INTL GAME TECHN,	13 559	179 645 €
INTL MINING MACH,	101 500	86 075 €
INTL PAPER	17 327	395 069 €
INTREPID MINES	98 261	84 587 €
INTUIT	69 684	2 822 894 €
INTUITIVE SURGICAL	1 538	548 536 €
INVESCO	16 832	260 480 €
INVESTORS REAL ESTA	29 666	166 703 €
INVISTA FOUNDATION	360 776	143 611 €
INVOCARE	23 669	143 936 €
IOOF HOLDINGS	45 977	185 912 €
IPSEN PROMESSE	7 236	175 473 €
IPSOS	87 540	1 921 503 €
IRESS MKT TECHN,	25 228	138 075 €
IRISH CONT, UNIT	71 574	1 085 778 €
IRON MOUNTAIN	7 796	184 961 €
ISETAN MITSUKOSHI	205 300	1 658 762 €
ISUZU MOTORS	1 022 000	3 642 691 €
ITE GROUP	911 427	2 225 920 €
ITOCHU	508 900	3 984 379 €
ITT	4 377	65 173 €
IVANHOE AUSTRALIA	56 420	63 273 €
IVANHOE MINES	11 234	153 741 €
IVG IMMOBILIEN	58 183	122 184 €
J,HARD,CHESS UNITS	88 575	477 082 €
JABIL CIRCUIT	9 092	137 690 €
JACOBS ENGINEERING	5 652	176 674 €
JAP,REAL EST,REIT	195	1 171 406 €
JAP,RET,FD REIT	730	833 200 €
JAPAN PRIME REIT	269	488 283 €
JAPAN STEEL WORKS	103 000	551 712 €
JAPAN TOBACCO	3 013	10 920 164 €
JARDIN,MATHES,HOLD	53 200	1 928 100 €
JARDINE CYCLE	29 000	829 014 €
JARDINE STRATEGIC	45 500	969 793 €
JB HI-FI	19 853	177 018 €
JCDECAUX	29 408	523 315 €
JERON,MARTINS ESC,	111 400	1 424 806 €
JFE HOLDINGS	56 500	788 556 €
JGC	28 000	518 062 €
JINCHUAN GROUP INTL	212 000	43 947 €
JM AB	374 936	4 718 667 €
JOHN WOOD CONSO	651 686	5 000 966 €
JOHNSON CONTROLS	27 212	655 251 €
JOHNSON ELECTRIC	368 000	156 585 €
JOHNSON JOHNSON	853 835	43 132 414 €
JOY GLOBAL	128 777	7 436 768 €
JPMORGAN CHASE	582 498	14 919 164 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
JSR	448 700	6 379 195 €
JTEKT	145 600	1 103 516 €
JU TENG INTERNATIONAL	170 000	15 007 €
JUNIPER NETWORKS	21 117	331 997 €
JX HOLDING INC 1 SEC	1 098 570	5 114 488 €
K REIT ASIA REIT	153 550	75 712 €
K&S NOM	84 028	2 934 258 €
K,WAH INTL HOLD,	205 000	40 056 €
K1 VENTURES	196 000	8 849 €
KABEL DEUTSCHLAND	121 638	4 770 034 €
KADOKAWA GROUP	12 800	342 940 €
KAGARA	142 178	28 633 €
KAI YUAN HOLDINGS	1 440 000	25 423 €
KAISA GROUP HOLDIN	386 000	51 302 €
KAJIMA	545 000	1 287 745 €
KAKAKU,COM	78 400	2 215 106 €
KANAMOTO	8 000	48 138 €
KANSAI ELEC,POW,	102 000	1 206 067 €
KANSAS CITY SOUTHN	4 300	225 268 €
KAPSCH TRAFFICOM	65 000	3 802 500 €
KAROON GAS AUSTRALIA	43 852	156 194 €
KAWASAKI HEAVY	1 280 000	2 460 553 €
KBC BANCASSURANCE	78 404	762 949 €
KDDI	2 060	10 209 251 €
KELLOGG	157 835	6 148 295 €
KENE,REA,INV,REIT	107	239 968 €
KEPPEL	270 700	1 495 580 €
KEPPEL LAND	424 251	559 518 €
KEPPEL TEL	11 000	7 254 €
KERRY GROUP CL,A	213 787	6 046 965 €
KERRY PROPERTIES	412 799	1 052 244 €
KESKO CL,B	29 925	776 853 €
KEYCORP	36 034	213 451 €
KILLAM PROPERTIES	16 628	145 543 €
KILROY REALTY CORP	22 037	646 240 €
KIMBERLY CLARK	127 067	7 200 007 €
KIMCO REALTY	167 651	2 097 252 €
KINDER MORGAN	123 269	3 054 663 €
KINDER MORGAN MGNT	97 058	5 870 431 €
KINEPOLIS GROUP	13 517	745 598 €
KING STONE ENERGY GR	361 000	26 854 €
KINGBOARD CHEMICAL	131 500	299 984 €
KINGBOARD LAMINATES	180 500	63 376 €
KINGDEE INTL SOFTW	367 200	76 119 €
KINGSGATE CONSOL,	29 365	132 191 €
KINGSOFT CORP LTD	112 000	32 215 €
KINROSS GOLD	361 419	3 179 864 €
KINTETSU WORLD EXP	162 100	3 635 402 €
KITE REALTY GP TRUST	23 110	80 285 €
KIWI INCOME	556 327	337 654 €
KLA TENCOR	6 772	251 694 €
KLEPIERRE	77 077	1 698 777 €
KLOEVERN	46 503	135 340 €
KOBAYASHI PHARM,	67 900	2 753 254 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
KOBE STEEL	478 000	569 503 €
KOHL S	80 460	3 058 620 €
KOMATSU	90 500	1 630 051 €
KOMERI	90 200	2 145 727 €
KON,BOSKALIS	196 183	5 569 635 €
KON,DSM NOM,	79 710	2 857 604 €
KON,PHILIPS ELEC,	442 914	7 210 640 €
KONE B	72 729	2 916 433 €
KONECRANES A	163 054	2 370 805 €
KONINKLIJKE AHOLD	1 800 372	18 732 871 €
KONINKLIJKE KPN	1 922 834	17 776 600 €
KONINKLIJKE VOPAK	141 947	5 794 986 €
KOWLOON DEV CO	70 000	47 212 €
KRAFT FOODS CL,A	155 091	4 463 257 €
KROGER	25 074	467 796 €
KUBOTA	515 000	3 325 741 €
KUEHNE UND NAGEL	51 429	4 469 692 €
KUNGSLEDEN	51 290	265 115 €
KUREHA	240 000	920 304 €
KWG PROPERTY HLDGS	231 500	60 159 €
KYOEI STEEL LTD	28 800	412 046 €
KYOWA HAKKO KOGYO	151 000	1 424 129 €
LABORATORY AMERICA	64 406	4 265 124 €
LAFARGE	34 114	926 536 €
LAFARGE PRIME FID,	60 000	1 629 600 €
LAGARDERE	57 215	1 167 186 €
LAI FUND HOLD	838 000	14 213 €
LAI SUN DEVELOPMEN	2 942 416	30 352 €
LAM RESEARCH	151 754	4 327 479 €
LAND SECURITIES	301 006	2 290 067 €
LANXESS	36 349	1 453 960 €
LAS VEGAS SANDS	14 239	468 674 €
LASALLE HOTEL	32 062	597 921 €
LAUDER ESTEE CL,A	4 594	397 472 €
LAURENT PERRIER	15 000	1 087 350 €
LAWSON	59 500	2 862 410 €
LEAR CORP	161 000	4 935 911 €
LEASINVEST REAL	573	37 239 €
LEE MAN PAPER	426 000	106 054 €
LEGG MASON	6 207	114 989 €
LEGGETT AND PLATT	6 296	111 739 €
LEGRAND PROMESSES	115 297	2 865 130 €
LEIGHTON HOLDINGS	33 504	503 804 €
LEM HDG SA REGISTER	1 980	627 976 €
LEND LEASE	116 280	657 530 €
LENNAR CL,A	6 883	104 183 €
LENZING	87 372	5 586 566 €
LEONI	140 208	3 610 356 €
LEUCADIA NATIONAL	7 723	135 280 €
LEXINGTON REALTY	59 142	341 221 €
LI AND FUNG LTD	1 222 000	1 742 909 €
LI NING	157 000	96 079 €
LIBERTY GLOBAL S,A	5 116	161 693 €
LIBERTY GLOBAL S,C	5 550	168 954 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
LIBERTY INTERACT,	22 196	277 236 €
LIBERTY INTL	260 321	973 282 €
LIBERTY MEDIA CAP A	73 630	4 426 761 €
LIBERTY PROP,PB	50 918	1 211 175 €
LIFE TECHNOLOGIES CO	7 147	214 212 €
LIFESTYLE INTL	133 500	226 689 €
LIJUN INTL PHARMA	190 000	16 772 €
LIMITED BRANDS	11 652	362 162 €
LINC ENERGY	74 537	64 753 €
LINCARE HOLDINGS	4 164	82 465 €
LINCOLN NATIONAL	11 297	168 994 €
LINDE	64 501	7 414 390 €
LINEAR TECHNOLOGY	8 361	193 407 €
LINN ENERGY LLC	7 100	207 334 €
LION SELECTION NV	62 867	30 783 €
LIONGOLD CORP LTD	105 000	54 268 €
LIPPO-MAPLETREE REAL	326 000	67 784 €
LOBLAW	4 689	136 500 €
L'OCCITANE INTL	86 750	134 227 €
LOEW'S	16 055	465 622 €
LONDON & STAMFORD	205 069	265 144 €
LONGFOR PROPERTIES	201 500	175 475 €
LONKING HLDGS	257 000	66 785 €
LOOMIS	147 070	1 636 076 €
LORILLARD	5 432	477 005 €
LOTTOMATICA	22 221	257 986 €
LOWES	50 358	984 506 €
LSI	23 907	109 572 €
LTC PROPERTIES	11 355	269 924 €
LUK FOOK	80 000	215 032 €
LULULEMON ATHLETIC	4 000	143 768 €
LUXOTTICA GROUP	60 656	1 316 235 €
LVMH MOET VUITTON	161 451	17 662 739 €
LYNAS COPORATION	353 903	292 078 €
LYONDELLBASELL IND	17 200	430 464 €
M AND T BANK	4 925	289 612 €
M,D	16 847	67 590 €
M,G,I	163 004	144 183 €
M,M,D CO LTD	380 000	8 443 €
MACERICH	56 763	2 212 454 €
MACK CALI REALTY	32 762	673 562 €
MACMAHON	147 197	65 101 €
MACQUARIE ATLAS ROAD	90 629	96 627 €
MACQUARIE GROUP	69 513	1 306 045 €
MACY S	430 101	10 661 416 €
MAGNA INTL CL,A	9 588	246 015 €
MAINFREIGHT	9 380	55 803 €
MAKINO MILLING MACHI	387 000	1 836 584 €
MAKITA	52 600	1 311 840 €
MAN ORD,	31 036	2 132 173 €
MAN WAH HOLDINGS	56 800	26 253 €
MANPOWER	3 465	95 420 €
MANULIFE FINANCIAL	71 031	583 036 €
MAOYE INTL HOLD,	207 000	32 439 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
MAPFRE	405 976	996 671 €
MAPLETREE INDUSTRI	412 106	263 182 €
MAPLETREE LOGISTICS	1 052 577	528 383 €
MARATHON OIL	27 439	618 656 €
MARATHON PETROLEUM	13 720	351 825 €
MARKEL	394	125 851 €
MARKS SPENCER GRP	976 045	3 634 024 €
MARRIOTT INTL CL,A	14 164	318 259 €
MARRIOTT VACA WORLD	1 546	20 436 €
MARSH MC LENNAN	301 954	7 354 634 €
MARUBENI	748 000	3 512 335 €
MARUICHI STEEL	53 000	911 103 €
MARVELL TECHNOLOGY	24 852	265 137 €
MASCO	14 946	120 655 €
MASTERCARD CL,A	4 789	1 375 316 €
MATSUSH,ELEC,IND,	102 700	672 465 €
MATTEL	14 058	300 609 €
MAXIM INTEGRATED	12 465	250 030 €
MAYR-MELNHOF	12 867	842 917 €
MC CORMICK NON VTG	119 208	4 629 847 €
MC GRAW HILL ORD,	164 094	5 684 261 €
MCDONALDS	290 291	22 434 830 €
MCKESSON	106 887	6 414 702 €
MCMILLAN SHAKESPEA	9 925	67 332 €
MDU RESOURCES GRP	7 458	123 285 €
MEAD JOHNSON NUTRI	8 089	428 252 €
MEADWESTVACO	7 362	169 844 €
MEDCO HEALTH SOL,	15 273	657 650 €
MEDIASET	371 866	795 050 €
MEDICA	139 387	1 812 031 €
MEDIOBANCA	185 998	826 947 €
MEDIOLANUM	94 565	284 452 €
MEDTRONIC	41 646	1 227 052 €
MEDUSA MINING	29 219	102 689 €
MEG ENERGY CORP	5 494	172 777 €
MEKONOMEN AB	71 385	1 804 819 €
MELCO INTL DEV,	184 000	105 302 €
MELROSE PLC	607 956	2 474 620 €
MERCIALYS	17 326	431 417 €
MERCK AND CO, NEW	327 497	9 510 582 €
MERCK KGAA	58 290	4 490 079 €
MERCURY GENERAL	1 189	41 783 €
MERMAID MARINE	42 261	94 789 €
MESOBLAST	41 544	226 061 €
METALL ZUG AG-SHS	740	2 251 273 €
METCASH	154 412	492 675 €
METLIFE	199 870	4 800 452 €
METRO	71 209	2 008 094 €
METROPCS CIONS,	10 532	70 419 €
METSO	173 906	4 982 407 €
MGM MIRAGE	14 860	119 388 €
MICHAEL KORS HOLD	123 591	2 594 250 €
MICHAEL PAGE INTL	492 957	2 058 463 €
MICHELIN	59 175	2 702 818 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
MICLYN EXPRESS OFFS	47 606	74 443 €
MICROCHIP TECHN,	382 462	10 791 544 €
MICRON TECHNOLOGY	39 387	190 837 €
MICROPORT SCIENTIF	56 000	21 273 €
MICROS SYSTEMS	111 100	3 986 318 €
MICROSOFT	1 910 924	38 212 592 €
MID AMERICA APARTM	15 789	760 747 €
MIDAS HOLDINGS	186 000	36 464 €
MIDLAND HOLD	110 000	44 078 €
MINCOR RESOURCES	40 131	21 393 €
MINEBEA	250 000	805 967 €
MINERAL RESOURCES	29 019	252 100 €
MINTH GROUP	162 000	117 135 €
MIRABELA NICKEL	109 292	96 673 €
MIRACA HOLDINGS	36 100	1 107 794 €
MIRAIT HOLDINGS CO	48 000	278 734 €
MIRVAC GROUP	2 059 607	1 919 394 €
MISUMI CORPORATION	41 400	732 831 €
MITSU,UFJ LEASE	67 600	2 064 277 €
MITSUB,ELECTRIC	840 000	6 206 648 €
MITSUBISHI	366 400	5 704 365 €
MITSUBISHI ESTATE	402 513	4 634 461 €
MITSUBISHI HEAVY	1 731 000	5 684 501 €
MITSUBISHI TANABE	204 300	2 491 364 €
MITSUBISHI TOKYO	7 112 950	23 287 291 €
MITSUI	1 384 300	16 589 979 €
MITSUI FUDOSAN	920 445	10 339 801 €
MITSUI MINING	363 000	723 238 €
MITSUI OSK	909 000	2 712 074 €
MIZUHO FCIAL GRP	7 095 200	7 387 873 €
MOBILEONE	75 000	111 388 €
MOBIMO	8 219	1 408 314 €
MOBISTAR	108 778	4 404 421 €
MOHAWK INDUSTRIES	2 572	118 575 €
MOLEX	2 920	53 668 €
MOLEX NON VOT,CL,A	2 981	45 420 €
MOLSON COORS CL,B	6 405	214 816 €
MONADELPHOUS GROUP	18 220	289 517 €
MONGOLIA ENERGY	1 012 000	70 262 €
MONSANTO	199 516	10 768 823 €
MOODY S	9 284	240 861 €
MORGAN STANLEY	56 737	661 247 €
MORGUARD REAL	15 940	192 942 €
MORI TRUST SOGO	46	289 227 €
MOTOROLA MOBILE	11 986	358 232 €
MOTOROLA SOLTN-ED	13 012	463 970 €
MPW US	41 805	317 837 €
MTR	351 000	875 568 €
MTU AERO ENGINES	95 551	4 724 041 €
MUNCHENER RUCKVERS	219 839	20 836 340 €
MURATA MFG	201 200	7 967 020 €
MURCHISON METALS	87 172	29 948 €
MURPHY OIL	7 645	328 249 €
MYER HOLDINGS	123 665	188 984 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
MYLAN	16 847	278 491 €
N,E	250 414	40 542 €
NABORS INDUSTRIES	11 782	157 372 €
NABTESCO CORP,	45 100	633 513 €
NAN HAI CORP	6 700 000	21 930 €
NAT,AUSTRALIA BANK	446 366	8 234 963 €
NAT,BANK CANADA	6 224	339 675 €
NAT,HEALTH INVTR	10 433	353 446 €
NATEXIS BQ,POPUL,	405 921	789 110 €
NATIONAL GRID TRAN	1 820 455	13 621 266 €
NATIONAL OILWELL	89 844	4 705 356 €
NATIONAL RETAIL PRO	40 079	814 423 €
NATUREX	27 000	1 401 300 €
NAVITAS	54 081	149 489 €
NCC GROUP PLC	347 437	3 472 082 €
NCR	6 389	81 007 €
NEC	1 079 000	1 685 262 €
NEO-NEON HOLDINGS	134 500	17 209 €
NEOPOST	31 061	1 617 036 €
NEPTUNE ORIENT	227 750	152 212 €
NESTE OY	56 880	443 948 €
NESTLE NOM,	325 409	14 475 728 €
NETAPP	425 669	11 892 632 €
NETFLIX INC	2 088	111 445 €
NEW HOPE CORP,	49 609	216 662 €
NEW TIMES ENERGY	81 600	4 775 €
NEW WORLD CHINA LD	1 484 500	228 222 €
NEW WORLD DEV,	2 696 266	1 674 101 €
NEW WORLD DPT	102 000	44 818 €
NEW YORK COMMUNITY	17 906	170 619 €
NEW ZEALAND O&G	77 139	32 680 €
NEWCREST MING	154 274	3 606 468 €
NEWELL RUBBERMAID	11 365	141 384 €
NEWFIELD EXPLOR,	5 259	152 844 €
NEWMONT MINING	174 245	8 054 570 €
NEWS CL,A	68 886	946 639 €
NEWS CL,B	23 871	334 290 €
NEXEN	21 157	259 451 €
NEXON CO LTD	11 700	129 675 €
NEXTERA ENERGY INC	35 640	1 671 363 €
NHK SPRING	151 000	1 031 057 €
NIBE INDUSTRIER B	206 600	2 362 158 €
NIDEC	166 100	11 125 441 €
NIELSEN HOLDINGS	5 500	125 786 €
NIEUWE SREEN W010413	6 940	- €
NIEUWE STEEN INV	22 415	211 822 €
NIHON PARKERIZING	304 000	2 812 335 €
NII HOLDINGS CL,B	6 617	108 567 €
NIKE CL,B	91 161	6 767 205 €
NIKKISO	171 000	1 121 396 €
NIKO RESOURCES	2 136	77 936 €
NIKON	62 600	1 074 253 €
NINE DRAGONS	277 000	134 349 €
NINTENDO	36 400	3 841 169 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
NIP,BUILD,FD REIT	228	1 438 126 €
NIPPON ACCOMMODATI	55	285 242 €
NIPPON DENKO	281 000	979 055 €
NIPPON EXPRESS	631 000	1 895 274 €
NIPPON KAYAKU	167 000	1 240 629 €
NIPPON MEAT PACK,	131 000	1 253 865 €
NIPPON PAPER GRP	77 000	1 295 154 €
NIPPON SHOKUBAI	571 000	4 727 843 €
NIPPON STEEL	356 000	684 341 €
NIPPON TELEG,TEL,	110 600	4 357 339 €
NISOURCE	10 448	191 624 €
NISSAN MOTOR	548 000	3 796 716 €
NISSIN ELECTRIC	287 000	1 235 583 €
NITORI CO	12 250	885 513 €
NKSJ HOLDINGS 1 SEC	625 300	9 453 374 €
NOBLE CORP	9 950	231 620 €
NOBLE ENERGY	84 275	6 127 498 €
NOBLE GROUP	982 090	659 277 €
NOK	146 900	1 945 822 €
NOKIA	1 645 651	6 207 396 €
NOKIAN RENKAAT	299 937	7 462 433 €
NOMURA HOLDINGS	863 000	2 013 206 €
NOMURA REAL REIT	114	451 412 €
NOMURA RL ESTATE	125 440	1 439 270 €
NORBERT DENTRESS,	21 474	1 159 596 €
NORDSTROM	8 755	335 242 €
NORFOLK SOUTHERN	15 961	895 793 €
NORITAKE	213 000	490 489 €
NORMA GROUP AG	72 917	1 160 474 €
NORTH MINING SHARE	1 840 000	35 952 €
NORTHEAST UTIL,	7 577	210 524 €
NORTHERN IRON LIMI	49 281	24 909 €
NORTHERN PPTY STP UT	11 027	247 927 €
NORTHERN TRUST	9 653	294 899 €
NORTHWEST HEALTHCA	12 991	112 922 €
NORWEGIAN PROPERTY	187 091	177 738 €
NOVARTIS	337 093	14 912 179 €
NOVO-NORDISK B	163 547	14 523 037 €
NOVOZYMES B NV	290 969	6 941 069 €
NRG ENERGY	10 147	141 630 €
NRW HOLDINGS	59 269	120 766 €
NS SOLUTIONS CORP	29 100	446 930 €
NSTAR	76 118	2 753 429 €
NTT DATA	759	1 867 863 €
NTT DOCOMO	11 839	16 772 312 €
NTT URBAN DEV,	494	259 662 €
NUANCE CIONS INC,	8 400	162 798 €
NUCOR	12 221	372 504 €
NUFARM	39 243	128 930 €
NUPLEX INDUSTRIES	37 477	51 573 €
NUTRECO HOLDING	92 530	4 704 225 €
NVC LIGHTING HLDG	239 000	68 034 €
NVIDIA	22 936	244 872 €
NVR	247	130 521 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
NWS HOLDINGS	214 000	242 820 €
NYSE EURONEXT	10 214	205 350 €
O REILLY AUTOMOT,	82 777	5 097 844 €
OAKTON	23 106	22 537 €
OBAYASHI	651 000	2 229 095 €
OBRASCON HUARTE	56 200	1 089 156 €
OCCIDENTAL PETROL,	323 089	23 319 550 €
OCEANS WILSONS	185 000	2 358 733 €
OCEANUS GROUP LTD	201 000	8 120 €
OIL SEARCH	267 011	1 317 974 €
OJI PAPER PROV,ECH	348 000	1 376 252 €
OLAM INTERNATIONAL	364 000	460 595 €
OLD MUTUAL	13 251	21 495 €
OLD REP,INTL ORD,	10 649	76 041 €
OM HLGDS LTD	75 152	18 993 €
OMEGA HEALTHCARE	38 271	570 439 €
OMNICARE	4 910	130 295 €
OMNICOM GROUP	93 278	3 203 153 €
OMRON	171 000	2 622 867 €
OMV	210 801	4 941 175 €
ONEOK	4 100	273 786 €
ONESTEEL	258 368	142 835 €
O-NET COMMUNICATIO	122 000	26 621 €
ORACLE	1 298 348	25 652 924 €
ORCHARD CLASSE A	106	- €
ORCHARD SUPPLY PF	106	- €
OREAL	230 445	18 596 912 €
ORICA	74 046	1 417 529 €
ORIENT OVERSEAS	50 000	224 901 €
ORIENTAL PRESS GRP	182 000	13 900 €
ORIGIN ENERGY	220 215	2 320 066 €
ORION CL,B	351 908	5 296 215 €
ORIX	202 560	12 898 294 €
ORIX JREIT REIT	516	1 640 268 €
ORPEA	189 981	4 784 671 €
OSAKA GAS	181 000	550 901 €
OSAKA TITANIUM	65 100	2 219 318 €
OSIM INTERNATIONAL	69 000	47 345 €
OSISKO MINING	274 318	2 042 054 €
OTSUKA	161 200	8 553 865 €
OTSUKA HOLDINGS CO	38 700	838 474 €
OUTOKUMPU CL,A	60 481	307 243 €
OUTOTEC	100 000	3 640 000 €
OVERS,CHINESE BKG	519 200	2 415 099 €
OWENS-ILLINOIS	6 599	98 512 €
OZ MINERALS	65 065	514 374 €
P,P,G,INDUSTRIES	6 545	420 923 €
PACCAR	15 219	439 267 €
PACIFIC ANDES RES	222 000	25 585 €
PACIFIC BASIN	386 000	119 067 €
PACIFIC BRANDS	186 625	81 064 €
PACIFIC TEXTILES	87 000	38 054 €
PADDY POWER	118 297	5 265 991 €
PAGESJAUNES	60 009	168 325 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
PALADIN ENERGY	170 656	184 646 €
PALL	103 129	4 539 996 €
PAN AMER,SILVER	14 083	237 371 €
PANAUST LTD	117 255	296 332 €
PANORAMIC RES,	40 876	37 448 €
PAPERLINX	110 314	7 318 €
PARAMOUNT BED HDG	4 000	93 793 €
PARK24	271 700	2 780 110 €
PARKER-HANNIFIN	6 321	371 265 €
PARKSON RETAIL GROUP	280 500	264 859 €
PARKWAY LIFE REAL	95 000	101 022 €
PARKWAY PROPERTIES	8 099	61 513 €
PARMALAT	151 654	201 700 €
PARTNERRE	66 512	3 289 736 €
PATRIZIA IMMOBIL,	9 311	31 909 €
PATTERSON CIES	5 199	118 221 €
PATTERSON-UTI	6 240	96 037 €
PAYCHEX	365 075	8 467 423 €
PCCW	1 126 000	298 191 €
PCD STORES (GROUP)	620 000	65 799 €
PCFIC RUB EGY	10 781	152 762 €
PEABODY ENERGY	131 633	3 357 240 €
PEAK SPORT PRODUCTS	169 000	34 195 €
PEARSON	516 969	7 488 717 €
PEBBLEBROOK HOTEL	19 085	281 968 €
PEET LTD	62 102	39 237 €
PEMBINA PPLN INC TR	82 184	1 844 065 €
PENN REAL ESTATE	20 685	166 347 €
PENN WEST ENERGY	18 100	276 460 €
PENNEY (J,C,)	8 474	229 442 €
PENNON GROUP	259 778	2 220 537 €
PENTAIR	5 024	128 831 €
PEOPLE S FOOD	172 000	66 417 €
PEOPLES UNITED	388 024	3 840 786 €
PEPCO HOLDINGS	9 838	153 837 €
PEPSICO	192 358	9 831 269 €
PERNOD-RICARD	115 304	8 262 685 €
PERPETUAL	9 855	159 009 €
PERRIGO	3 678	275 666 €
PERSEUS MINING	83 825	158 885 €
PETROLIERE IMP,	69 142	2 374 214 €
PETSMART	4 420	174 628 €
PEUGEOT S,A,	76 589	927 493 €
PFEIFFER VACUUM	128 958	8 720 140 €
PFIZER	1 552 362	25 876 686 €
PG AND E	337 800	10 725 709 €
PHARMASSET	3 000	296 256 €
PHARMAXIS,LTD	59 447	48 827 €
PHILIP MORRIS	342 644	20 713 835 €
PHOENIX SATELLITE TV	302 000	58 709 €
PIEDMONT OFFICE REAL	65 188	855 649 €
PINAULT PRINTEMPS	41 755	4 620 191 €
PINNACLE WEST	5 328	197 738 €
PIONEER NAT,RES,	4 785	329 812 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
PIRELLI & C	457 637	2 976 929 €
PITNEY BOWES ORD,	8 220	117 392 €
PLAINS EXPLORATION	5 720	161 792 €
PLATINUM AM	44 876	124 754 €
PLATINUM AUSTRA	89 871	5 820 €
PLUM CREEK TIMBER	6 453	181 730 €
PMS	29 707	51 850 €
PNC FIN,SCES GROUP	160 171	7 115 284 €
POINT	48 350	1 582 945 €
POLA ORBIS HOLDING	57 900	1 205 767 €
POLYTEC ASSET	255 000	20 487 €
PORSHE AUTOMOBILE	67 277	2 781 904 €
PORTS DESIGN	84 500	98 394 €
PORTUGAL TELE,NOM,	1 094 686	4 871 353 €
POST PROPERTIES	18 785	632 630 €
POSTNL NV	173 735	427 388 €
POTASH SASKATCHEW,	33 403	1 064 115 €
POU SHENG INTL HDG	336 000	32 660 €
POWER CORP,CANADA	16 609	299 297 €
POWER FINANCIAL	11 059	213 675 €
POWERLONG REAL EST	320 000	33 009 €
PPL	24 000	543 892 €
PRAXAIR	15 673	1 290 590 €
PREC,CASTPARTS	68 795	8 732 651 €
PREMER INVT LTD	23 259	87 253 €
PREMIER INVESTMENT	52	130 052 €
PREMIER OIL	740 000	3 215 851 €
PRI HEALTH CARE	104 997	255 403 €
PRICE T ROWE GROUP	9 514	417 364 €
PRICELINE,COM	20 188	7 273 247 €
PRIMARIS RETAIL	30 145	470 014 €
PRIMARY HEALTH	25 212	96 133 €
PRIME OFFICE AG	14 335	62 314 €
PRINCIPAL FCIAL	11 645	220 665 €
PROCTER GAMBLE	364 751	18 743 290 €
PROGRESSIVE	59 128	888 605 €
PROGRESSIVE ENERGY	121 827	5 257 086 €
PROLOGIS	192 790	4 245 776 €
PROSAFE	1 470 167	7 778 471 €
PROSPERITY REAL	234 000	34 814 €
PRUDENTIAL FCIAL	108 565	4 191 402 €
PRYSMIAN	685 158	6 574 091 €
PS BUSINESS PARKS	6 948	296 663 €
PSP SWISS PROPERTY	18 510	1 198 522 €
PUBLIC FINANCIAL	60 000	20 650 €
PUBLIC POWER CORP	51 739	196 608 €
PUBLIC SCE ENT,	20 377	518 136 €
PUBLIC STORAGE	64 698	6 701 042 €
PUBLICIS GROUPE	110 762	3 937 035 €
PUMA R,RUDOLF ECH,	19 493	4 385 925 €
QANTAS AIRWAYS	231 705	267 169 €
QBE INS,GROUP	226 150	2 312 938 €
QEP RESOURCES	6 907	155 889 €
QIAGEN	531 063	5 655 821 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
QUALCOMM	495 140	20 862 855 €
QUEST DIAGNOSTICS	47 082	2 105 670 €
QUESTAR	6 752	103 293 €
QUINTAIN ESTATES	192 335	86 923 €
RAFFLES MEDICAL GP	51 000	64 231 €
RAFLES EDUCATION NV	138 333	34 926 €
RAIFFEIS,INTL BK	25 591	513 483 €
RAKUTEN	12 035	9 976 952 €
RALPH LAUREN A	2 468	262 503 €
RAMCO GERSHENS,PB	14 308	108 341 €
RAMELIUS RESOURCES	76 691	64 505 €
RAMIRENT OYJ	263 814	1 450 977 €
RAMSAY HEALTH CARE	31 120	473 854 €
RANDGOLD RESOURCES	63 661	5 018 648 €
RANDSTAD PROV,DIV,	55 578	1 270 513 €
RANGE RESOURCES	93 132	4 443 534 €
RATIONAL	31 000	5 214 200 €
RAUTARUUKKI	46 319	329 560 €
RAYMOND JAMES FIN,	74 500	1 776 706 €
REAL GOLD MINING LTD	90 500	79 080 €
REAL NUTRICEUTICAL	89 000	22 422 €
REALESTATE,COM,AU	11 977	118 238 €
REALTY INCOME	50 853	1 369 451 €
RECKITT BENCKISER	206 756	7 871 233 €
RED ELECTRICA	23 609	780 632 €
RED HAT	5 596	177 984 €
REED ELSEVIER	509 244	3 164 104 €
REED ELSEVIER	523 213	4 712 579 €
REGAL HOTELS INTL	82 000	19 113 €
REGENCY CENTERS	39 827	1 154 130 €
REGENERON PHARM,	3 500	149 442 €
REGENT PACIFIC GRP	391 000	10 083 €
REGIONS FINANCIAL	48 903	161 980 €
REGIS RESOURCES	84 092	224 476 €
REJECT SHOP LTD	5 195	42 259 €
RELIANCE STEEL ALU	52 100	1 954 051 €
REMY COINTREAU	44 998	2 793 926 €
RENAISSANCE RE HLD	43 934	2 516 848 €
RENAULT	97 386	2 609 945 €
RENHE COMMERCIAL	1 760 000	155 363 €
RENISHAW PLC	366 384	4 408 188 €
REPSOL YPF	686 475	16 293 484 €
REPUBLIC SCES	36 551	775 674 €
RESEARCH IN MOTION	21 419	239 816 €
RESOLUTION	302 005	908 944 €
RESONA HOLDINGS	177 400	602 109 €
RESTAURANT GROUP	802 100	2 860 596 €
RETAIL OPPORTUNITY	15 543	141 757 €
REX MINERALS	29 393	32 383 €
REXAM	424 433	1 792 649 €
REXEL PROMESSES	36 034	475 649 €
REXLOT HOLDINGS	1 175 000	59 436 €
REYNOLDS AMERICAN	64 037	2 043 146 €
RHEINMETALL ORD,	74 231	2 541 298 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
RHON KLINIKUM	121 707	1 791 527 €
RIETER HOLDING	23 197	2 696 348 €
RIGHTMOVE	253 100	3 769 381 €
RINNAI	33 900	1 870 134 €
RIO TINTO	88 167	4 198 760 €
RIOCAN REAL UNIT	113 944	2 278 277 €
RLJ LODGING TR SBI	41 698	540 577 €
RM	92 078	119 261 €
ROAD KING	59 000	26 041 €
ROBERT HALF INTL	6 431	140 985 €
ROC OIL COMPANY	125 804	25 336 €
ROCHE HOLDING BJ	118 548	15 547 279 €
ROCKWELL AUTOMAT,	5 558	314 120 €
ROCKWELL COLLINS	9 747	415 723 €
ROCKWOOL INTL S,B	60 461	3 748 510 €
ROGERS CIONS CL,B	102 664	3 048 426 €
ROHTO PHARM,	302 000	2 993 392 €
ROLLS-ROYCE JV12 C	10 626 483	- €
ROPER INDUSTRIES	96 625	6 465 732 €
ROSS STORES	14 172	518 869 €
ROTORK PLC	526 017	12 153 871 €
ROVI CORP	4 376	82 855 €
ROWAN COS	5 267	123 054 €
ROYAL BANK CANADA	56 377	2 216 951 €
ROYAL DUTCH SHELL	244 019	6 926 482 €
ROYAL DUTCH SHELL	509 331	14 963 466 €
RPC GROUP	176 636	757 042 €
RPS GROUP PLC	810 000	1 745 481 €
RSA INSURANCE GRP,	2 340 685	2 947 924 €
RUBIS	62 890	2 540 756 €
RWE	252 737	6 861 810 €
RYANAIR HOLDINGS	1 091 174	3 957 688 €
RYDER SYSTEM	2 663	109 006 €
RYOHIN KEIKAKU	25 500	958 675 €
S,A,R LTD	116 000	126 799 €
S,E	32 801	42 743 €
S,R	591 155	184 415 €
S,S LTD	33 423	64 671 €
SA SA INTERNATIONAL	168 000	71 651 €
SAFESTORE HOLDING	69 233	82 884 €
SAFEWAY	14 472	234 549 €
SAF-HOLLAND SA	94 607	336 328 €
SAFRAN	91 863	2 131 681 €
SAIC	306 401	2 900 684 €
SAINSBURY	1 052 817	3 817 769 €
SAINT MARC HOLDINGS	26 500	786 669 €
SAINT-GOBAIN	233 559	6 928 528 €
SAIPEM	143 508	4 714 238 €
SAIZERIYA	164 000	2 106 648 €
SALESFORCE,COM	84 209	6 581 301 €
SALZGITTER	19 667	759 736 €
SAMLING GLOBAL	866 000	32 640 €
SAMPO A	657 166	12 597 872 €
SANDFIRE RESOURCES	21 728	112 913 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
SANDISK	9 403	356 433 €
SANDS CHINA	490 800	1 068 523 €
SANOFI AVENTIS	823 383	46 726 985 €
SANOMA-WSOY	20 999	186 156 €
SANTOS	186 820	1 805 937 €
SANY HEAVY EQUIPME	183 000	114 895 €
SAP SYSTEME ORD,	629 860	25 729 781 €
SAPUTO	5 993	176 954 €
SARA LEE	23 713	345 594 €
SARACEN MINERAL	120 532	71 394 €
SAUL CENTERS	5 225	142 559 €
SAWAI PHARM,	23 100	1 847 907 €
SBM OFFSHORE	75 565	1 202 995 €
SCAG	28 216	117 882 €
SCANA	5 212	180 906 €
SCHEIN HENRY	15 887	788 476 €
SCHIBSTED	147 700	2 838 735 €
SCHINDLER HOLD,BP	67 078	6 045 253 €
SCHINDLER HOLD,NOM	6 915	621 490 €
SCHLUMBERGER ORD	308 932	16 255 696 €
SCHNEIDER ELECTRIC	241 390	9 819 745 €
SCHOELLER BLECKM,	157 748	10 761 569 €
SCHWAB CHARLES	48 945	424 527 €
SCOR REGPT	529 087	9 555 311 €
SCOTT,SOUTH,ENERGY	913 038	14 111 482 €
SCRIPPS NETWORKS	3 923	128 188 €
SDL PLC	360 000	2 866 036 €
SEAGATE TECHNOLOGIE	322 442	4 073 370 €
SEALED AIR	7 781	103 151 €
SEARS HOLDINGS	2 355	57 651 €
SEB	27 215	1 581 736 €
SEEK	69 095	309 405 €
SEGRO NV09	308 843	770 906 €
SEI INVESTMENTS	5 629	75 230 €
SEKISUI HOUSE	125 000	854 776 €
SEMBCORP IND,	179 000	430 672 €
SEMBCORP MARINE	167 000	378 982 €
SEMICOND,MFG INTL	4 188 000	155 770 €
SEMPRA ENERGY	9 696	410 784 €
SENIOR	1 338 679	2 740 502 €
SENIOR HOUSING	62 525	1 080 774 €
SERCO GROUP	1 021 490	5 796 555 €
SES GLOBAL FDR	432 267	7 958 035 €
SEVEN AND I HOLD,	282 400	6 064 758 €
SEVEN GRP HOLDINGS	23 746	132 777 €
SEVEN WEST MEDIA	42 915	109 813 €
SEVERFIELD-ROWEN	499 399	995 450 €
SG	39 227	139 410 €
SGS NOM,	11 242	14 400 947 €
SHAFTESBURY	1 255 351	7 021 429 €
SHANGHAI INDUSTRIA	388 000	53 877 €
SHANGRI LA ASIA	314 833	418 437 €
SHARP	51 000	343 642 €
SHAW CIONS CL,B	16 754	256 662 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
SHENGUAN HOLDINGS	196 000	87 481 €
SHENZHEN INVESTMENT	1 035 158	142 714 €
SHENZHOU INTL	76 000	79 451 €
SHERWIN-WILLIAMS	32 180	2 212 840 €
SHIMACHU	71 400	1 261 724 €
SHIMADZU	509 000	3 322 667 €
SHIMAO PROPERTY	816 478	536 912 €
SHIRE	125 438	3 368 340 €
SHOPPERS DRUG MART	8 857	275 657 €
SHOWA DENKO KK	876 000	1 368 202 €
SHUI ON LAND	1 495 352	350 026 €
SHUN TAK HOLDINGS	334 000	96 070 €
SHW AG	26 983	499 186 €
SIA ENGINEERING	47 000	95 770 €
SIEMENS	401 730	29 703 916 €
SIGMA PHARMA,	234 577	101 893 €
SIGMA-ALDRICH	48 451	2 331 112 €
SIKA POR,	1 676	2 443 793 €
SILIC	34 567	2 590 105 €
SILVER BASE GROUP	94 000	58 737 €
SILVER LAKE RESOUR	42 384	100 755 €
SILVER WHEATON	13 664	304 942 €
SIMCORP	19 449	2 294 921 €
SIMON PROPERTY GRP	123 964	12 312 370 €
SIMS	41 275	412 359 €
SINGAMAS CONTAINER	362 000	52 780 €
SINGAPORE AIRLINES	121 000	730 327 €
SINGAPORE AIRPORT	164 890	210 606 €
SINGAPORE EXCHANGE	218 000	793 881 €
SINGAPORE POST	300 000	166 637 €
SINGAPORE PRESS	319 000	699 287 €
SINGAPORE TELECOM,	1 608 000	2 951 773 €
SINO BIOPHARMA	496 000	113 642 €
SINO LAND	1 748 513	1 918 089 €
SINO OIL AND GAS H	2 690 000	73 372 €
SINO PROSPER STATE	1 320 000	11 129 €
SINO UNION PETROLEUM	580 000	30 489 €
SINOLINK WORLDWIDE	536 000	30 835 €
SIRIUS XM RADIO INC	1 517 017	2 126 769 €
SJM HLDGS LTD	447 000	562 175 €
SKISTAR AB	108 527	996 942 €
SKY CITY ENTERT,	121 833	251 851 €
SKY NETWORK TV	38 016	121 077 €
SKYWORTH DIGITAL	404 000	108 992 €
SL GREEN REALTY	32 932	1 690 486 €
SLIGRO FOOD GROUP	250 559	5 199 099 €
SLM	645 434	6 662 160 €
SM ENERGY	74 500	4 195 001 €
SMA SOLAR TECHNOLO	4 723	203 868 €
SMARTONE TELECOM,	107 000	142 636 €
SMC	26 200	3 257 950 €
SMITH(DS)	1 075 155	2 548 554 €
SMITHFIELD FOODS	6 913	129 293 €
SMRT CORP,	152 000	159 829 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
SMUCKER	41 121	2 476 066 €
SNAM RETE GAS	4 315 248	14 697 735 €
SNC LAVALIN	6 064	234 330 €
SOCAM DEVELOPMENT	30 316	21 559 €
SOCIETE GENERALE A	340 679	5 861 382 €
SODEXHO ALLIANCE	120 032	6 658 175 €
SOFTBANK	499 150	11 329 326 €
SOFTWARE	126 193	3 603 441 €
SOHO CHINA LTD	1 197 528	614 074 €
SOLVAY	18 371	1 169 498 €
SO-NET M3	680	2 362 435 €
SONIC HEALTHCARE	77 968	694 581 €
SONY	154 600	2 139 139 €
SONY FIN,HOLD,	360 700	4 095 252 €
SOUTHERN	269 708	9 616 995 €
SOUTHERN COPPER	9 882	229 733 €
SOUTHERN UNION	5 200	168 674 €
SOUTHWEST AIRLINES	33 470	220 693 €
SOUTHWEST,ENERGY	13 703	337 139 €
SOVRAN SELF	10 327	339 434 €
SP AUSNET UNITS	300 164	222 835 €
SPARK INFRASTRUCT,	275 390	299 053 €
SPARKLE ROLL GROUP	440 000	32 731 €
SPECTRA ENERGY	167 994	3 979 214 €
SPECTRIS	93 439	1 441 912 €
SPIRAX-SARCO ENG,	201 407	4 516 166 €
SPONDA	104 201	325 107 €
SPOTLESS GROUP	51 920	97 591 €
SPRINT FON COM,S,1	117 907	212 527 €
SPX	2 131	98 933 €
SRE GR	548 000	18 752 €
ST BARBARA	65 047	99 661 €
ST JUDE MEDICAL	256 338	6 772 757 €
ST MODWEN PROP,	55 747	75 415 €
ST TELEMEDIA ORD	60 829	63 894 €
ST, JAMES S PLACE	336 404	1 306 873 €
STAGECOACH GROUP NV	695 152	2 261 970 €
STALLERGENES	45 000	1 899 000 €
STANLEY BLACK DECKER	7 062	367 733 €
STAPLES	28 707	307 149 €
STAR MICRONICS	89 900	627 356 €
STARBUCKS	479 986	17 011 366 €
STARHILL GLOBALREIT	114 000	38 264 €
STARHUB	136 000	235 110 €
STARWOOD HOTELS	7 951	293 799 €
STATE STREET	19 395	602 228 €
STATOILHYDRO	196 619	3 895 682 €
STATS CHIPPAC	89 000	23 793 €
STEDIM	49 400	2 420 600 €
STELLA INTL HOLDINGS	48 000	80 363 €
STERICYCLE	110 142	6 610 896 €
STMICROELECTRONICS	302 076	1 386 831 €
STOCKLAND	1 408 926	3 549 577 €
STOCKMANN S,B	154 300	1 848 514 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
STORA ENSO S,R	270 118	1 250 106 €
STOREBRAND	326 075	1 308 963 €
STRABAG	15 523	343 214 €
STRAITS METALS	50 989	26 175 €
STRATEC BIOMEDICAL	43 721	1 388 142 €
STRATEGIC HOTELS	65 641	271 524 €
STRAUMANN HOLDING	28 613	3 820 881 €
STRYKER	11 559	442 611 €
STW CIONS GROUP	73 356	48 665 €
SUDZUCKER	25 191	620 958 €
SUEZ ENVIRON,COMP,	167 482	1 490 757 €
SULZER	38 006	3 143 424 €
SUMISHO COMPUTER	138 200	1 699 135 €
SUMITOMO	423 100	4 413 999 €
SUMITOMO REALTY	445 066	6 006 698 €
SUMITOMO BAKELITE	299 000	1 290 238 €
SUMITOMO CHEMICAL	1 032 000	2 903 404 €
SUMITOMO ELECTRIC	301 600	2 530 445 €
SUMITOMO METAL	402 000	3 980 557 €
SUMITOMO MITSUI	548 500	11 773 969 €
SUMITOMO RUBBER	550 100	5 089 031 €
SUN COMMUNITIES	7 799	219 456 €
SUN HUNG KAI PROP,	1 131 728	10 927 548 €
SUN LIFE FINANCIAL	22 601	323 152 €
SUNCOR ENERGY	62 317	1 385 084 €
SUNCORP GROUP	261 615	1 731 428 €
SUNLAND GROUP	20 949	10 920 €
SUNLIGHT REIT	236 000	51 965 €
SUNOCO	4 726	149 330 €
SUNSTONE HOTEL	44 268	277 911 €
SUNTEC REAL ESTATE	1 286 170	821 382 €
SUNTRUST BANKS	21 065	287 206 €
SUPER GROUP	82 000	64 059 €
SWEDISH MATCH	105 493	2 895 951 €
SWIBER HOLDINGS	77 000	24 473 €
SWIRE PACIFIC CL,A	183 500	1 706 287 €
SWISS PRIME SITE	16 437	955 293 €
SWISSCOM NOM,	49 723	14 578 150 €
SWISSQUOTE GROUP	63 200	1 718 099 €
SYDNEY AIRPORT UNITS	148 856	312 713 €
SYMANTEC	77 960	939 820 €
SYMRISE	133 092	2 744 357 €
SYNEAR FOOD HLDGS	244 000	18 699 €
SYNERGY HEALTH	63 006	638 508 €
SYNGENTA NOM,	46 410	10 513 840 €
SYNOPSYS	160 212	3 356 776 €
SYNTHESES	109 227	14 171 886 €
SYSCO	23 207	524 312 €
SYSMEX	147 200	3 696 211 €
T AND D	969 300	6 958 231 €
TABCORP HOLDINGS	145 361	313 407 €
TAG TEGERNSEE IMMO	322 633	1 987 419 €
TAI CHEUNG HOLD	94 000	44 286 €
TAIHEIYO CEMENT	2 974 000	4 377 032 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
TAISEI	613 000	1 178 374 €
TAKEDA PHARMA,	91 400	3 093 032 €
TALISMAN ENERGY	41 424	406 766 €
TANGER FACTORY OUT	36 332	820 563 €
TAP OIL	51 904	24 390 €
TARGET	218 673	8 627 662 €
TAT HONG	34 000	17 775 €
TATTS GROUP	273 004	526 086 €
TAUBMAN CENTERS	23 738	1 135 518 €
TCC INTL HOLD,	200 000	52 568 €
TCL COMM TECH HLDG	107 000	37 039 €
TD AMERITRADE HLDG	10 225	123 264 €
TDC	558 215	3 459 365 €
TDK	44 500	1 519 273 €
TE CONNECTIVITY LTD	16 746	397 430 €
TECHNIP	48 601	3 529 405 €
TECHNOPOLIS	23 302	78 062 €
TECHTRONIC INDUST,	239 000	189 404 €
TECK COMINCO CL,B	22 877	621 487 €
TECO ENERGY	8 182	120 631 €
TED BAKER	283 335	2 197 178 €
TELECITY GROUP PLC	371 475	2 877 341 €
TELECOM ITAL,EPAR,	10 951 565	7 578 483 €
TELECOM ITAL,ORD,	5 877 289	4 884 027 €
TELECOM NEW ZEALD	387 327	481 802 €
TELEFONICA	2 815 518	37 685 708 €
TELEKOM AUSTRIA	146 632	1 354 586 €
TELENET GROUP HOLD	217 254	6 406 820 €
TELEPHONE DATA SYS	2 070	41 282 €
TELEVISION BROADC,	66 000	308 326 €
TELIASONERA	176 862	929 493 €
TELSTRA	885 983	2 330 061 €
TELUS	11 668	508 790 €
TELUS N,VTG	36 729	1 518 230 €
TEN NETWORK HOLD,	158 969	105 460 €
TENARIS	207 448	2 962 357 €
TENCENT HOLD	185 800	2 876 692 €
TERADATA	6 571	245 539 €
TERNA	4 954 256	12 900 883 €
TERUMO	119 100	4 322 562 €
TESCO	2 652 703	12 812 559 €
TEXAS INSTRUMENTS	45 402	1 018 065 €
TEXWINCA HOLD,DIV,	134 000	114 566 €
TF1	70 342	530 519 €
TGS-NOPEC GEOPHYS,	871 190	14 899 730 €
THALES	35 564	867 762 €
THE LINK REIT	1 310 914	3 718 647 €
THE MOSAIC	234 612	9 113 760 €
THERMO FISHER	15 129	524 073 €
THK	197 600	3 001 193 €
THOMSON REUTERS	82 732	1 704 272 €
THYSSENKRUPP	169 237	2 999 726 €
TIANNENG POWER INTL	164 000	56 932 €
TIFFANY	5 060	258 262 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
TIGER AIRWAYS HLDG	79 500	29 990 €
TIGER RESOURCES	116 613	33 615 €
TIM HORTONS	7 069	263 968 €
TIME WARNER	221 593	6 168 827 €
TIME WARNER CABLE-WI	12 971	635 161 €
TINGYI HOLDING	456 000	1 067 386 €
TITAN PETROCHEMICALS	780 000	24 370 €
TJX COS	15 072	749 420 €
TNT EXPRESS NV	300 941	1 737 633 €
TOBU RAILWAY	224 000	881 378 €
TOD S GROUP	53 420	3 368 131 €
TOKAI CARBON	604 000	2 527 753 €
TOKIO MARINE HOLD,	484 800	8 275 771 €
TOKYO STEEL MFG	184 900	1 158 865 €
TOKYO TATEMONO	122 117	284 874 €
TOKYU LAND	467 156	1 361 057 €
TOKYU REIT	47	181 873 €
TOLL BROTHERS	5 219	82 092 €
TOLL HOLDINGS	144 062	480 131 €
TOM GROUP	312 000	21 043 €
TOM TAILOR HOLDING	175 951	2 164 197 €
TOMORROW FOCUS	271 100	908 456 €
TOMRA SYSTEMS	192 582	996 804 €
TOMSON GROUP	142 000	25 774 €
TOP REIT	58	200 631 €
TORAY INDUSTRIES	1 549 000	8 545 244 €
TORCHMARK	5 026	167 985 €
TORONTO DOMIN BANK	35 556	2 052 099 €
TOSHIBA	1 690 000	5 329 896 €
TOSHIBA PLANT	146 000	1 141 630 €
TOSOH	150 000	309 371 €
TOTAL FINA	1 343 620	53 072 990 €
TOTAL SYSTEM SERV,	105 410	1 588 214 €
TOUR EIFFEL	2 075	79 742 €
TOWER	38 450	35 352 €
TOWNGAS CHINA	144 000	59 987 €
TOYO KOHAN	10 000	26 632 €
TOYO TANSO	44 500	1 412 345 €
TOYOTA MOTOR	1 103 000	28 325 941 €
TPV TECHNOLOGY	198 000	27 887 €
TRANSALTA	8 598	136 725 €
TRANSATLANTIC HOLD	2 396	101 011 €
TRANSCANADA	270 979	9 128 642 €
TRANSFIELD SCES	111 425	190 079 €
TRANSGLOBE APART	27 751	245 421 €
TRANSPACIFIC IND,	231 445	148 971 €
TRANSURBAN UNIT	292 712	1 299 196 €
TRAVELERS COS,	203 463	9 273 537 €
TRAVIS PERKINS	215 669	2 053 929 €
TREASURY WINE EST	133 343	387 539 €
TREVI FIN,IND,	291 569	1 433 353 €
TRINITY	258 000	143 302 €
TRIPADVISOR	52 020	1 010 187 €
TROY RESOURCES	17 100	57 531 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
TRULY INTL HLDGS	231 000	30 931 €
TRYGVESTA	232 464	9 977 398 €
TS TECH	66 300	809 168 €
TUI NOM,	109 454	525 051 €
TULLETT PREBON	441 802	1 428 068 €
TYCO INTL	418 894	15 072 053 €
TYSON FOODS CL,A	12 030	191 264 €
U S BANCORP	561 690	11 703 678 €
U STORE IT TRUST	37 324	305 906 €
UBE INDUSTRIES	277 000	585 172 €
UBI BANCA	398 675	1 262 205 €
UCB	60 248	1 958 662 €
UDR	85 385	1 650 873 €
UK COMMERCIAL	133 510	110 526 €
ULTRA ELECTRONICS	160 000	2 831 079 €
ULTRA PETROLEUM	6 055	138 199 €
UMICORE	132 417	4 220 130 €
UNIBAIL	135 667	18 844 146 €
UNICREDIT	638 049	4 096 275 €
UNILEVER	475 158	12 304 163 €
UNILEVER	1 244 966	33 078 747 €
UNION PACIFIC ORD,	201 493	16 442 897 €
UNI-PRESIDENT CHINA	217 000	100 082 €
UNIT 4 AGRESSO	90 185	1 650 386 €
UNITE GROUP	59 327	119 322 €
UNITED BUSINESS	350 183	2 001 405 €
UNITED CONTINENTAL	13 100	190 415 €
UNITED ENERGY GROUP	770 000	100 048 €
UNITED ENGINEERS	39 000	43 557 €
UNITED GROUP	33 104	311 118 €
UNITED LABORATORIE	76 000	33 695 €
UNITED OVS BK LCL	237 000	2 149 938 €
UNITED PARCEL CL,B	134 267	7 569 713 €
UNITED TECHNO,	330 750	18 621 566 €
UNITED UTILITIES	197 959	1 436 168 €
UNITEDHEALTH GROUP	253 572	9 899 113 €
UNIV,HEAL,SCE CL,B	3 639	108 929 €
UNIVERSAL HEALTH	4 709	141 466 €
UNUM GROUP	12 425	201 660 €
UOB-KAY HIAN HOLD,	57 000	51 978 €
UOL GROUP	120 000	285 154 €
UPM KYMMENE	226 867	1 930 638 €
URBAN OUTFITTERS I	4 889	103 791 €
URSTADT BIDDLE A	7 704	107 293 €
UTD INTERNET NOM,	215 073	2 968 007 €
UTD STATES STEEL	5 668	115 526 €
UTD URB,INV,REIT	794	693 995 €
VACON OYJ	246 776	7 625 378 €
VALEANT PHARM INTL	12 295	443 303 €
VALEO	120 468	3 699 572 €
VALERO ENERGY	22 209	360 114 €
VALLOUREC	51 918	2 604 207 €
VALUE PARTNERS GRP	171 000	67 503 €
VARIAN MEDICAL SYS	4 436	229 386 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
VARITRONIX INTL	85 000	27 737 €
VASTNED RETAIL	6 950	240 470 €
VECTOR LIMITED	59 193	87 859 €
VEIDEKKE	322 216	1 609 562 €
VENTAS	120 674	5 124 601 €
VENTURE CORP,	55 000	202 578 €
VEOLIA ENVIRON,	228 086	1 931 660 €
VERBUND	96 180	1 994 292 €
VERISIGN	52 369	1 440 934 €
VERISK ANALYTICS A	183 173	5 662 250 €
VERIZON CIONS	391 073	12 085 849 €
VERTEX PHARM,	8 035	205 548 €
VETROPACK HOLDINGS	1 238	1 672 560 €
VF	4 285	419 159 €
VIACOM CL,B	138 633	4 849 272 €
VICTREX PLC	524 092	6 876 629 €
VIENNA INSUR,GROUP	17 002	520 601 €
VINCI	248 015	8 372 986 €
VINDA INTL HLDGS	137 000	135 475 €
VIRBAC	88 184	10 573 262 €
VIRGIN HOLDINGS	441 960	99 478 €
VIRGIN MEDIA	13 075	215 332 €
VISA INC LTD	153 714	12 021 709 €
VISCOFAN	134 999	3 869 071 €
VITASOY INTL HDGS	154 000	87 370 €
VIVENDI UNIVERSAL	1 027 731	17 389 209 €
VMWARE A	3 522	225 693 €
VODAFONE GROUP	6 842 412	14 654 705 €
VODONE LTD	646 000	65 355 €
VOESTALPINE	73 257	1 587 479 €
VOLKSWAGEN ORD,	12 845	1 331 384 €
VOLKSWAGEN PF	74 766	8 654 165 €
VORNADO REALTY	78 621	4 654 760 €
VTECH HOLDINGS	37 600	290 143 €
VULCAN MATERIALS	4 914	148 949 €
W,A NL	26 858	107 967 €
WACKER CHEMIE	6 969	433 123 €
WAL MART STORES	470 868	21 675 452 €
WALGREEN	35 415	901 879 €
WALLENSTAM	431 111	3 076 146 €
WANT WANT CHINA	1 339 000	1 029 264 €
WAREHOUS,DISTRIB,	3 500	129 710 €
WAREHOUSE GROUP	30 701	55 347 €
WARTSILA	86 889	1 939 362 €
WASH,REAL ESTATE	24 835	523 215 €
WASHINGTON POST B	3 002	871 348 €
WASION GROUP HOLDING	94 000	21 444 €
WASTE CONNECTIONS	134 630	3 436 788 €
WASTE MANAGEMENT	197 457	4 975 211 €
WATERS	3 335	190 230 €
WATPAC	33 000	27 626 €
WATSON PHARMACEUT,	179 682	8 351 573 €
WEATHERFORD	29 359	331 086 €
WEIGHT WATCHERS	1 688	71 527 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
WEINGARTEN RTY IN	50 100	842 075 €
WEIR GROUP	183 825	4 471 835 €
WELLING HOLDINGS	220 400	26 232 €
WELLPOINT INC	14 121	720 626 €
WELLS FARGO	914 151	19 406 872 €
WENDEL INVEST,	11 038	568 457 €
WERELDHAVE	8 017	411 352 €
WERELDHAVE BELGIUM	1 731	115 804 €
WESFARMERS	202 713	4 722 819 €
WESFARMERS	30 794	723 520 €
WEST CHINA CEMENT	624 000	80 459 €
WEST JAPAN RAILWAY	20 600	689 898 €
WESTERN DIGITAL	127 575	3 041 478 €
WESTERN UNION	119 567	1 681 785 €
WESTF,GRP ST,UNITS	1 354 886	8 357 021 €
WESTFIELD	1 810 133	3 559 652 €
WESTPAC BANKING	613 557	9 691 313 €
WEYERHAEUSER	21 460	308 626 €
WHARF HOLDINGS	889 268	3 095 883 €
WHEELLOCK	162 000	309 147 €
WHEELLOCK PROP,	73 000	65 484 €
WHIRLPOOL	3 115	113 855 €
WHITE ENERGY	45 966	13 795 €
WHITE MOUNTAINS	266	92 914 €
WHITEHAVEN COAL LTD	74 494	311 225 €
WHITEROCK REIT	10 101	101 174 €
WHK GR	53 147	34 628 €
WHOLE FOODS MARKET	75 200	4 030 516 €
WIHLBORGS FASTIGH,	62 222	376 857 €
WIHLBORGS SYD	28 085	287 184 €
WILLIAM DEMANT	36 659	2 355 678 €
WILLIAMS COMPANIES	22 983	584 578 €
WILLIS GROUP HDG LLC	90 050	2 691 373 €
WILMAR INTL	514 000	1 526 763 €
WINCOR NIXDORF	109 863	3 793 569 €
WINDSTREAM	152 198	1 376 371 €
WING HANG BANK	47 000	296 716 €
WING TAI HOLDINGS	341 690	191 824 €
WINTHROP REALTY	9 016	70 631 €
WIRECARD	194 800	2 419 416 €
WISCONSIN ENERGY	141 312	3 805 475 €
WM,MORRIS,SUPERM,	2 677 692	10 456 879 €
WNR CHILCOTT CL A	7 254	84 542 €
WOLTERS KLUWER	132 421	1 768 482 €
WOODSIDE PETROLEUM	122 585	2 964 423 €
WOOLWORTHS	245 622	4 868 988 €
WORKSPACE GROUP REIT	53 459	144 479 €
WORLEYPARSONS	49 249	998 438 €
WOTIF,COM HLDGS	20 928	59 006 €
WYNDHAM WORLDWIDE	222 317	6 478 395 €
WYNN MACAU LTD	314 800	608 855 €
WYNN RESORTS	3 736	317 972 €
XCEL ENERGY	174 640	3 718 263 €
XEBIO	78 400	1 437 229 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
XEROX ORD,	617 341	3 785 268 €
XILINX	10 270	253 625 €
XINGDA INTL HLDGS	119 000	41 310 €
XINYI GLASS HLDGS	576 000	254 802 €
XL GROUP	12 452	189 629 €
XTEP INTERNATIONAL	174 500	42 577 €
XYLEM	216 955	4 293 309 €
YAHOO	77 447	962 271 €
YAMADA DENKI	58 830	3 086 396 €
YAMANA GOLD	322 674	3 666 500 €
YAMATO	94 200	1 223 242 €
YAMATO KOGYO	209 000	4 624 449 €
YANGZIJ,SHIPBUILD,	409 000	221 107 €
YANLORD LAND GROUP	336 715	191 031 €
YASKAWA ELECTRIC	227 000	1 488 636 €
YING LI INTL REAL	211 000	31 964 €
YINGDE GASES GROUP	177 000	139 217 €
YIP'S CHEMICAL	54 000	31 332 €
YOOX	255 596	2 131 671 €
YOROZU	62 600	1 101 830 €
YUE YUEN IND,	169 000	411 512 €
YUM BRANDS	18 581	844 604 €
ZARDOYA OTIS	64 739	686 233 €
ZHONGSHENG GRP HLD	74 500	95 617 €
ZIMMER HOLDINGS	7 177	295 328 €
ZIONS BANCORP,	7 310	91 671 €
ZODIAC	18 272	1 196 451 €
ZUBLIN IMMOBILIEN	17 798	35 188 €
ZUMTOBEL	209 500	2 244 793 €
ZURICH FINANC,SCES	82 768	14 489 002 €

BONDS

Total (€)	19 193 474 677 €
------------------	-------------------------

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
3I GROUP 5,625 17	2000	2 047 781 €
A2A SPA 4,50%1116	2000	1 923 892 €
ABB INTL 4,625%13	550	587 856 €
ABBAY SVC 3,125 14	2900	2 942 868 €
ABBAY SVC 3,375% 15	5188	4 863 377 €
ABBOTT LAB 4,125%20	11810	10 070 609 €
ABC 3,5% 2021	7400	5 888 256 €
ABERTIS 4,625% 1016	12	578 317 €
ABERTIS 4,75%14	20	2 098 546 €
ABERTIS 5,125%0617	52	2 553 657 €
ABN 6,375% 2021	10700	10 144 172 €
ABNAMRO NV 2,75% 13	13088	13 101 535 €
ABNAMRO NV 3,37% 14	430	446 055 €
ABNAMRO NV 4,25% 16	9270	9 741 567 €
ACAFP 5,125% 2023	3000000	3 136 821 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
ACE HLD 2,60 15	1633	1 268 171 €
ACE INA 6,7% 05/36	4000	3 991 556 €
ACEA 4,50%10-2020	1000	900 958 €
ACGB 5,75% 15/07/22	16600	15 674 690 €
ACUITY BANDS 6% 19	1600	1 391 892 €
ADECCO ,4,75% 2018	2018	2 076 466 €
ADOBE SYS 3,25% 15	3515	2 865 942 €
ADP 3,875% 02/22	2	201 971 €
AETNA 3,95%20	1221	981 160 €
AFD 3,625%10-2020	1800000	1 870 170 €
AFLAC IN 8,5 05/19	2111	2 020 328 €
AG,FSE,DEV,TV PERP	1250000	938 980 €
AGILENT 5%0720 SR	1420	1 229 087 €
AGILENT TECH INC	3000	2 584 330 €
AGRIUM 6,125% 01/41	980	944 621 €
AGRIUM IN 7,125 36	2450	2 525 196 €
AGRIUM INC 6,75% 19	3650	3 484 250 €
AIG 6,40 15/12/20	7222	5 610 751 €
AIG SUN,4,75%13	4000	4 075 779 €
AIR LIQFI 3,889 20	3800000	4 136 063 €
AKZO NOB 7,75% 14	20	1 180 947 €
ALCAN INC 7,25 31	339	358 711 €
ALCOA 5,4% 2021	2400	1 865 518 €
ALL 5% 15/08/2014	3000	2 537 303 €
ALLD WA HL 7,5 16	2365	2 114 245 €
ALLEGHENY 5,95% 2021	4750	3 991 222 €
ALLEMA 0,75 09/13	9200000	9 324 101 €
ALLEMAGN 0,75% 04/18	7450000	7 994 296 €
ALLEMAGNE 2,75%04/16	4000000	4 436 248 €
ALLEMAGNE 2500 0215	190000	206 395 €
ALLEMAGNE 3,25%15	9000000	10 015 999 €
ALLEMAGNE 3,5%13	13000000	13 902 756 €
ALLEMAGNE 3,50%16	6000000	6 700 680 €
ALLEMAGNE 3,75% 19	56800	6 594 764 €
ALLEMAGNE 3,75%15	20700000	22 776 624 €
ALLEMAGNE 3,75%17	9700000	11 091 077 €
ALLEMAGNE 4%040118	10650000	12 457 838 €
ALLEMAGNE 4%16	20000000	23 338 386 €
ALLEMAGNE 4%37	55770000	71 804 990 €
ALLEMAGNE 4,25%14	19800000	21 417 660 €
ALLEMAGNE 4,25%14	15000000	16 818 092 €
ALLEMAGNE 4,25%18	7200000	8 724 284 €
ALLEMAGNE 4,25%39	32730000	45 491 300 €
ALLEMAGNE 4,75%07/40	5400000	8 125 703 €
ALLEMAGNE 4,75%34	6500000	9 202 114 €
ALLEMAGNE 5 5/8%28	5600000	7 998 816 €
ALLEMAGNE 5,50%31	6100000	8 863 483 €
ALLEMAGNE 6,25%24	12120000	17 474 980 €
ALLEMAGNE 6,25%30	4800000	7 412 352 €
ALLEMAGNE 6,50%27	4300000	6 758 300 €
ALLEMAGNE TV 20 INFL	34960856,46	43 270 835 €
ALLEMAGNE TV13	6922138,8	8 086 268 €
ALLEMAGNE TV16	3500000	4 345 943 €
ALLERGAN 5,75% 16	1485	1 341 115 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
ALLIAND 4,875% 2015	3800	3 800 913 €
ALLIANZ 5,75% 2041	85	7 469 449 €
ALLIANZ FIN,4%1116	106	5 644 183 €
ALLIANZ II TV25 SR	3000	3 191 332 €
ALLIANZ TV04-PERP,	3400	3 188 018 €
ALLIANZFIN 4,75%0719	60	3 308 921 €
ALLSTATE 7,45%2019	312	294 800 €
ALLTEL 7,875 07/32	928	1 016 952 €
ALSTOM 2,875% 2015	600000	588 593 €
ALSTOM 4% 23/09/2014	4850000	4 995 485 €
ALSTOM 4,125% 2017	300000	307 421 €
ALSTOM 4,50% 180320	1000000	985 742 €
ALTADIS EMIS,4%15	1000	1 040 333 €
ALTRIA 10,2% 39	5733	6 962 329 €
ALTRIA GROUP INC	6950	5 896 658 €
ALTRIA GRP 9,25% 19	5500	5 815 112 €
AM,MOVIL 5,50%14	4600	3 874 147 €
AMCOR 4,625% 04/19	1000	1 076 712 €
AMER 5,04999 09/20	1500	1 169 940 €
AMER 5,875% 01/21	1700	6 374 946 €
AMER EXPRESS2,8%16	12700	9 924 887 €
AMER IGP 8,175% 58	1635	1 121 801 €
AMER INTL 5,45%07-17	10250	7 636 368 €
AMER MOVIL 3,75%17	3100	3 287 479 €
AMER MOVIL 4,75%22	2000	2 147 297 €
AMER TOWER 4,50 18	2431	1 933 124 €
AMER TOWER 4,625% 15	291	234 373 €
AMER,4,25%13 S,E	284000	23 626 945 €
AMERADE 7,125%03-33	4000	4 067 333 €
AMERICA MOV 2,375%16	4610	3 565 853 €
AMERICA MOV 4,125%19	1250	1 291 746 €
AMERICAN 4 3/8%16	72	3 338 073 €
AMERICAN 6,25%13	8	439 973 €
AMERICAN 7%18 SR	6200	5 870 833 €
AMERICAN INTERNTL GR	9160	7 082 313 €
AMERIPRIS 7,518 66	2000	1 562 766 €
AMERIQUE 0,625% 13	150000	11 639 487 €
AMERIQUE 0,75% 13	100000	7 772 890 €
AMERIQUE 0,75% 14	153000	11 919 284 €
AMERIQUE 1,5%12/2013	150000	11 845 677 €
AMERIQUE 2% 2021	171800	13 414 808 €
AMERIQUE 2,625%18	70000	5 934 385 €
AMERIQUE 2,875%13	50000	4 010 812 €
AMERIQUE 2,875%18	70000	5 996 805 €
AMERIQUE 3 7/8%13	150000	12 202 946 €
AMERIQUE 3,75%11-18	50000	4 500 202 €
AMERIQUE 3,875%18	70000	6 319 322 €
AMERIQUE 4%14 S,B	150000	12 640 006 €
AMERIQUE 4,25%14 E	251000	21 621 236 €
AMERIQUE 4,25%15 E	65000	5 757 939 €
AMERIQUE 4,25%17	157000	14 357 192 €
AMERIQUE 4,375% 2041	146800	14 773 611 €
AMERIQUE 4,5%15	126000	11 223 119 €
AMERIQUE 4,75%14C	80000	6 848 673 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
AMERIQUE 5% 07-37	105000	11 428 208 €
AMERIQUE 5,25% 28	23000	2 454 378 €
AMERIQUE 5,25%29	28000	3 022 481 €
AMERIQUE 5,375% 2031	20000	2 226 819 €
AMERIQUE 6 1/8%27	25000	2 877 436 €
AMERIQUE 6,25%23	25000	2 801 760 €
AMERIQUE 6,25%30	20000	2 394 889 €
AMERIQUE 6,50%26	28300	3 326 162 €
AMERIQUE 6,75%26	50000	6 046 651 €
AMERIQUE 7 1/8%23	91000	10 790 518 €
AMERIQUE 8 1/8%19	132000	15 443 572 €
AMERIQUE 8%NOV21	30000	3 636 163 €
AMERIQUE 9 1/8%18	96000	11 126 621 €
AMERIQUE 9,25%16	179000	19 111 767 €
AMERIQUE8,75%MAY20	142000	17 258 332 €
AMERISOUR 4,875%2019	2520	2 161 150 €
AMEX CRE 7,3% 08/13	2949	2 526 918 €
AMGEN 4,375%11-2018	280	296 281 €
AMGEN 4,85%14 SR	3385	2 849 108 €
AMGEN 5,65% 2042	89	73 280 €
AMGEN 6,4% 01/02/39	4600	4 190 670 €
AMGEN INC 4,5% 20	7400	6 071 426 €
AMGEN INC 5,15% 1141	20836	16 407 427 €
AMT 5,9% 2021	1765	1 438 732 €
ANADARKO 5,95%16	862	760 332 €
ANADARKO 6,375 17	5667	5 127 025 €
ANGLETER 4,5% 03/13	5050000	6 430 908 €
ANGLETERRE 4%16	9600000	13 282 355 €
ANGLETERRE 4,25%%55	4400000	6 786 089 €
ANGLETERRE 4,25%32	3100000	4 535 690 €
ANGLETERRE 4,25%36	6800000	10 087 109 €
ANGLETERRE 4,25%46	7800000	11 720 225 €
ANGLETERRE 4,75%15	117000	16 339 051 €
ANGLETERRE 4,75%20	12600000	18 831 990 €
ANGLETERRE 4,75%38	4600000	7 319 050 €
ANGLETERRE 5%14	70800	9 657 795 €
ANGLETERRE 5%18	3000000	4 445 892 €
ANGLETERRE 5%25	2300000	3 631 388 €
ANGLETERRE 6%28	8200000	14 493 428 €
ANGLETERRE 8%13	5000000	6 906 740 €
ANGLETERRE 8%21	3000000	5 519 965 €
ANGLETERRE 8,75%17	61000	10 586 514 €
ANGLIAN 4 5/8%13	2300	2 438 843 €
ANGLO 5,875%170415	5000	5 716 030 €
ANGLO ICAP 7,5 14	2000	2 120 174 €
ANGLOGOL 5,375 2020	2225	1 718 205 €
ANHEUS 2,875% 2016	9160	7 529 099 €
ANHEUS 4,125% 15	4065	3 440 078 €
ANHEUS 5,375 20	4450	4 089 745 €
ANHEUS BUS 6,57 14	600	691 884 €
ANHEUS BUS 8% 11/39	5500	6 609 062 €
ANHEUSER 7,75%2019	7800	8 006 337 €
ANHEUSER BU 4% 06/21	610	649 123 €
ANZ 5,125%09-19	1930	1 960 558 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
AOL TIME 7 5/8%31	600	598 185 €
AON 3,50%300915	2025	1 613 509 €
APACHE 3,625%10-2021	4750	3 971 589 €
APPALACHIAN 7%38	2750	2 855 923 €
APPLIE MAT 4,625% 16	5490	4 347 125 €
APPLIE MAT 5,85% 41	2500	2 161 815 €
ARCELMIT 9,375% 0616	4910	5 722 810 €
ARCELOR 3,75% 2015	7000	5 246 769 €
ARCELOR 6,125 18	9035	6 914 291 €
ARCELOR TF 13	1300	1 434 164 €
AREVA 3,875%09/16	600000	574 863 €
AREVA 4,875% 0924	900000	736 766 €
AREVA SA	2800000	2 293 567 €
ARISTOTLE 4,75% 2021	7000	5 620 186 €
ARROW ELEC 3,375%15	4650	3 619 873 €
ASCIANO 5%11-2018	1285	1 010 087 €
ASF 7,375%09-2019	5000000	6 198 429 €
ASML HOLD,5,75%17	1645	1 801 368 €
ASSI GEN 5,125% 0924	4400	3 921 381 €
ASSOC BANC-5,125%16	3655	2 948 485 €
AT AND T 5,50%18	4905	4 460 501 €
AT AND T 6,125%15	145	8 513 138 €
AT& T INC 2,5% 15	4485	3 610 742 €
AT& T INC 5,55% 41	3000	2 747 111 €
AT& T INC 6,5 37	1280	1 232 405 €
AT&T 3,875% 2021	5271	4 351 798 €
AT&T 5,35% 2040	3000	2 620 272 €
AT&T 6,45% 06-34	4600	4 267 576 €
ATLANTIA 4,375% 25	365	316 933 €
ATLANTIA 5%14	50	5 223 160 €
ATLANTIA 5,625%09-16	1100	1 177 414 €
ATMOS 8,50% 03/19	3900	4 057 947 €
ATT 6,55% 0239	13760	13 609 281 €
AUCHAN 3,625% 2018	700000	729 894 €
AUCHAN SA 3% 12/16	50	5 127 607 €
AUST NZ BK 3375 0317	4600	4 841 765 €
AUSTRAL PROP UNI	3000	2 342 235 €
AUSTRALIA 4,75 %16	16200	13 609 689 €
AUSTRALIA 4,75 27	2000	1 717 691 €
AUSTRALIA 5,25 19	22600	20 117 070 €
AUSTRALIA 5,5% 13	14520	12 001 189 €
AUSTRALIA 5,75 21	6500	6 010 062 €
AUSTRALIA 6,25 14	4600	3 909 346 €
AUSTRALIAN GOVT,	2000	1 698 484 €
AUSTRALIE 6%17	9200	8 348 953 €
AUSTRALIE 6,25%15	20000	17 525 983 €
AUSTRALIE 6,5%13	9300	7 720 866 €
AUTOZONE 5,75% 01/15	9160	7 941 181 €
AUTOZONE 6,5%08-2014	1500	1 302 412 €
AUTRICHE 3,50%21	7130000	7 565 677 €
AUTRICHE 4,15%0337	14490000	16 774 341 €
AUTRICHE 6,25%27 6	17380000	23 896 324 €
AVIAT CAP 6,75% 21	3465	2 751 070 €
AVIAT CAP 7,125%20	3218	2 543 467 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
AVIVA TV23	1220	11 719 974 €
AVIVA TVPERP,	120	901 448 €
AXA 5,777%06-PERP,	3000	2 153 061 €
AXA 6%013 EMTN	5850	6 292 534 €
AXA 6,211%07-2017	2554	1 785 355 €
AXA 8,6 15/12/30	200	151 141 €
AXA SA 5,25%04-40	72	2 766 979 €
AXIS FINANC 5,875%20	1530	1 219 787 €
B,POP,CV BD4,25%13	8200000	8 693 468 €
BAA 4,6%20 EMTN	3300	3 489 674 €
BAA FUND 3975 0214	450	466 711 €
BAA FUNDIN 4,12 16	510	522 147 €
BAA FUNDING 4,6%16	1100	1 161 177 €
BACR 4,75% PERPETU	50	257 358 €
BANCO ESPAN,3,5%16	61	6 002 868 €
BANCO POP 4% 2013	1530	1 489 082 €
BANCORP 2,2% 2016	6550	5 113 045 €
BANK 4,5/8%17 MTN	12	504 673 €
BANK 5,125%14 EMTN	43	2 103 093 €
BANK AMER 5,3 17	380	270 229 €
BANK AMER,5,75%17	719	2 625 859 €
BANK AMERICA 5,65%18	8225	30 210 735 €
BANK OF AMER,4%15	2	95 888 €
BANK OF AMERICA 7%16	42	2 203 037 €
BANK OF NY 4,3% 0514	4900	4 062 421 €
BANK OF SC 4,50%21	3810	3 994 924 €
BANSAB 4,375% 05-12	25	2 562 636 €
BARCL LOND 2,5 13	3560	2 752 873 €
BARCL LOND 4,125%16	400	413 923 €
BARCL LOND 6% 2021	1250	1 111 770 €
BARCLAYS 6,75% 0519	6400	5 470 541 €
BARCLAYS 4,875%08-19	4200	4 277 155 €
BARCLAYS 5,25% 05/14	20450	21 862 978 €
BARCLAYS 6%18 EMTN	400	381 183 €
BARCLAYS 6,05%1217	22890	15 991 997 €
BARCLAYS BK 4,875%14	50	287 762 €
BARCLAYS BK 5,14%20	4130	2 788 123 €
BARCLAYS BK 6,625%22	3000	2 692 509 €
BARCLAYS TV17 EMTN	1555	1 433 120 €
BARR 5,95000 10/39	4365	3 889 789 €
BARRICK 6,125%2013	9160	7 743 842 €
BARRICK 6,8%2018	4600	4 309 227 €
BARRICK GD 2,9% 2016	1955	1 549 466 €
BARRICK GOL 1,75% 14	2330	1 814 540 €
BARRICK NOR 5,70% 41	3135	2 835 394 €
BASFIN 5,125%06-15	60	3 417 977 €
BAT HLDNV 4 07/20	200	210 178 €
BAT INT FIN 8,5% 18	4000	4 233 987 €
BAT INTL 5 3/8%17	10400	12 191 322 €
BAT INTL 5,875%15	800	926 988 €
BATSLN 4,0875%02-21	2300	2 614 705 €
BAXTER 5,9%010916	3450	6 420 573 €
BAYER,HYPO,6%14	2300	2 347 770 €
BAYER,LDBK 5,75%17	6	307 029 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
BB AND T 5,2% 2015	7590	6 247 332 €
BB&T 2,05%28/04/2014	4000	3 127 217 €
BB&T CAP 6,82%2057	4800	3 735 946 €
BBVA 4,25% 03/15	5	255 553 €
BBVA 4,75% 02/2016	258	13 458 505 €
BBVA S 3,625% 05/12	114	5 817 621 €
BBVA SENI 3,875% 15	198	9 639 304 €
BBVA SENIO 4,875 14	14	733 756 €
BBVAS 4,875% 2016	41	4 171 807 €
BBVASM 3,25% 2014	2100	1 522 902 €
BBVASM 3,25%04-15	41	1 980 161 €
BCO BILB,4 3/8%19	17	1 253 010 €
BCO BILBAO 4,25%13	128	13 290 868 €
BCO POPOLARE 6%10-20	630	465 460 €
BCO SANT 4,625%01/16	21	2 193 287 €
BCO SANTAN,4,50%19	19	1 442 448 €
BCO SANTAND,3,5%14	30	3 043 487 €
BCO SANTANDER 4%20	39	3 648 320 €
BCOPOP SC 4,125% 14	20	887 930 €
BCOPOP SCR 3,75% 12	16	800 623 €
BEI 4,75%151017	24250000	27 523 563 €
BELG,OLO 4,25%14	1000000	1 049 670 €
BELGELEC 5,125%15	10000000	11 170 053 €
BELGIQUE 3,25%16	1500000	1 520 643 €
BELGIQUE 3,75%2040	6500000	6 756 301 €
BELGIQUE 4%22 OLO	11660000	11 974 933 €
BELGIQUE 4%280314	3000000	3 176 849 €
BELGIQUE 4%280318	14490000	15 266 080 €
BELGIQUE 4,25%0913	4000000	4 178 279 €
BELGIQUE 5%35 OLO	22520000	25 730 780 €
BELGIQUE 5,5%17	4600000	5 127 697 €
BELGIQUE 5,50%28	2100000	2 488 935 €
BELLSTH CP 6,55 34	3305	3 044 095 €
BEMIS CO 6,8% 0819	3570	3 400 437 €
BERKSHIRE HATHAWAY	9400	7 265 780 €
BERTELSMAN 7875 0114	3600	4 277 667 €
BEST BUY 3,75% 2016	1435	1 107 415 €
BFCM	8000000	8 439 949 €
BFCM 3,75% 2018	2800	2 767 995 €
BFCM 4% 22/10/20	8500000	6 639 753 €
BFCM 4,25% 050214	4000	4 217 816 €
BG ENERGY 3% 2018	3350	3 369 083 €
BHP FINANC 5,25 15	5550	4 917 581 €
BHP FINANC 5,5% 14	9160	7 830 158 €
BK AME,4%18 EMTN	66	2 412 200 €
BK CANADA 2,625% 15	5500	4 354 776 €
BK MELLON 2,4% 01/17	10000	7 720 331 €
BK NEWYORK 3,55% 21	5640	4 431 192 €
BK OF SCO 4,875%19	111	6 061 455 €
BK SCOTL, 5,5%12	2000	1 981 817 €
BKAMERICA 4,5 15	1258	4 723 823 €
BKAMERICA 4,625% 17	49	2 232 183 €
BKAMERICA 4,875 13	2000	1 582 615 €
BKAMERICA 5,625% 16	1832	6 882 418 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
BKAMERICA 6,5% 16	1527	6 049 041 €
BKAMERICA 7,375 14	2253	9 086 263 €
BKAMERICA 7,625 19	1305	5 218 390 €
BLACK+DECKER8,95%14	1041	940 765 €
BLACKST HLD 5,875%21	7000	5 487 781 €
BLOCK 5,125%14	3000	2 365 547 €
BMW FI 4% 17/09/14	24040	25 568 044 €
BMW FIN 3,25 16	2000	2 141 146 €
BMW FIN 8,875%09-13	5700	6 515 761 €
BMW FIN,3,625%2018	300	317 163 €
BNG 2,50 15/11/17	7000	7 046 027 €
BNP CAP,TV PERP,	1497	1 573 774 €
BNP PARIB 3,5 %16	1500000	1 554 653 €
BNP PARIBAS 3,25%12	4000	4 106 919 €
BNP PARIBAS 8,667%13	2400000	2 209 350 €
BNP PARIBAS TV08-18	60	2 541 128 €
BNP TV311249 PERP,	800000	597 621 €
BNP2,625% 160916EMTN	5861000	5 744 538 €
BNZ INTL 4 03/17	1000	1 032 875 €
BOA 4,75%03/04/2017	140	6 582 728 €
BOA 5,625% 2020	2270	8 088 372 €
BOBL 1,25 10/16	4000000	4 104 960 €
BOBL155 2,5 10/14	2000000	2 133 009 €
BOBL157 2,25 04/15	10000000	10 752 669 €
BOEING 3,75 11/16	4150	3 522 012 €
BOEING 4,875% 02/20	4600	4 200 283 €
BOEING 5,875 %40	225	227 349 €
BONO 2,5% 31/10/13	13900	13 748 766 €
BONOS 4,3%10-19	5000	4 913 283 €
BOSTON PROP 3,7% 18	2835	2 242 618 €
BOTTLING 5,125% 0119	4600	4 196 230 €
BOTTLING G 6,95 14	3477	3 077 108 €
BOUYGUES 3,641% 2019	1000000	973 865 €
BOUYGUES 4,75%06-16	2100000	2 307 713 €
BP 3,561ù 2021	5800	4 653 858 €
BP CAPITAL 3,2%16	8065	6 574 723 €
BP CAPMKT 3,625% 14	10000	8 139 723 €
BP CAPMKTS 3,1% 14	290	302 632 €
BP CAPMKTS 3,83 %17	8000	8 575 904 €
BPCE 2,875% 09/15	1200000	1 161 755 €
BPCE 3,75 07/17	9750000	9 504 404 €
BPCE TF/TV PERP	300000	232 554 €
BQ PSA FIN 4,25% 16	2400	2 273 148 €
BQPOP CVB 2,625% 15	15000000	15 081 504 €
BQUE PSA 3,25% 12	565	566 414 €
BQUE PSA 4 06/15	1500	1 420 623 €
BRAMBLES 4,625% 18	7720	8 405 681 €
BRANDYWINE 6% 0416	4600000	3 756 926 €
BRISA 4,50%051216	34	1 115 129 €
BRITAM TOB 3,625% 21	330	329 425 €
BRITISH 4,375%14	800	864 223 €
BRITSIH TEL 6,125%14	1200	1 350 565 €
BRK 3,45% 2021	1667	1 328 207 €
BRK 4,95% 2041	4000	3 428 409 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
BRK 5,75%01/04/2018	9000	8 063 702 €
BROADCOM 2,70% 11/18	5075	3 941 804 €
BSCHA 1,75 06/13	9000000	9 321 555 €
BT TEL,6,5%070715	11100	12 880 937 €
BT TELECOM 5,25%13	250	270 905 €
BTP 3 01/04/14	3000	2 888 211 €
BTP 3,75 01/03/21	4000	3 335 151 €
BTP 4,25 01/03/20	4000	3 514 939 €
BTP 4,75 01/09/21	14400	12 712 634 €
BTPS 3,75% 05-15	8000	7 622 134 €
BTPS 4% FEV 2037	6300	4 508 636 €
BTPS 4,25% 01/09/19	4000	3 531 339 €
BTPS 4,5% 01/03/26	1000	805 143 €
BTPS 5%01-03-2025	8700	7 414 491 €
BUCKEYE LP 4,87% 21	1690	1 394 099 €
BUND 2% 04/01/22	8000000	8 144 014 €
BUND 2,25 04/09/21	5000000	5 248 874 €
BUND 2,25 09/20	1580000	1 670 234 €
BUND 2,5 04/01/21	22910000	24 488 728 €
BUND 3 04/07/20	32220000	36 271 728 €
BUND 3,25 01/20	6300000	7 114 968 €
BUND 3,25 07/42	4500000	5 431 990 €
BUND 3,5 04/07/19	20175000	23 467 270 €
BUNDERSREPUB DEUTSCH	4000000	5 350 279 €
BUNDESLAND 4,25%17	10150000	12 155 601 €
BUNDESSCHAT 1,5% 13	14000000	14 427 418 €
BUNGE 4,10% 03/16	9160	7 401 409 €
BUONI POLIEN 5% 0940	3000	2 403 271 €
BURL 4,70000 10/19	8065	7 010 323 €
BUSINESS 5,75% 2020	3785	3 211 807 €
C AGRICOLE 7,875%19	400000	314 193 €
CA INC 5,375%09-2019	4000	3 336 796 €
CADES 1,5 07/21	8048000	8 080 018 €
CADES 3,625%250416	25430000	27 255 037 €
CADES 4,5%2013	21700000	23 087 064 €
CAIXA 5,125 04/16	60	3 107 841 €
CAJA AHORR3,875%35	92	7 465 973 €
CALONE CAP 10,25% 39	3750	3 093 090 €
CAN NATL 5,7% 05/17	6600	6 000 897 €
CAN NATL 5,9% 02/18	4545	4 233 638 €
CAN NATL 6,25% 38	1100	1 087 688 €
CANADA 1,5 11/13	15300	11 720 993 €
CANADA 1,5%03/17	500000	382 077 €
CANADA 2 01/08/13	5000	3 876 491 €
CANADA 2,25 08/14	12300	9 691 550 €
CANADA 2,5 06/15	5500	4 363 754 €
CANADA 2,75 06/22	3500	2 828 760 €
CANADA 2,75 09/16	6100	4 964 578 €
CANADA 3,25 06/21	4600	3 880 263 €
CANADA 3,5 06/13	28050	22 040 428 €
CANADA 3,5 06/20	11600	9 934 924 €
CANADA 3,5 12/45	700	650 306 €
CANADA 3,75 06/19	6650	5 773 545 €
CANADA 4 01/06/41	8000	7 965 963 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
CANADA 4%010617	4800	4 138 186 €
CANADA 4%16	5300	4 497 757 €
CANADA 4,25 06/18	6900	6 111 885 €
CANADA 4,50%15	13400	11 326 330 €
CANADA 5 06/37	9000	9 979 883 €
CANADA 5%14	3100	2 580 064 €
CANADA 5,75% 06/33	5100	5 950 956 €
CANADA 5,75%29	7900	8 851 910 €
CANADA 8%27	2600	3 438 943 €
CANADA-GOV'T	10700	8 677 896 €
CANADIAN NATL 6,2%36	605	611 647 €
CAPITAL 6,15%16 SR	8500	6 903 336 €
CAPITAL ONE 2,125%14	1700	1 304 319 €
CAPITAL ONE 4,75%12	1429	1 163 180 €
CAPITAL ONE 8,8%2019	940	865 812 €
CAREFUSION 6,375%19	924	855 767 €
CARGILL 4,307% 05/21	2576	2 165 157 €
CARLB 6% 28/05/14	5400	6 044 163 €
CARLSB BR 3,375% 17	1000	1 009 744 €
CAROLINA P 6,3 38	1760	1 869 671 €
CASINO 4,472% 16	1400000	1 423 270 €
CASINO 4,481 18	3850000	3 707 469 €
CASINO 4,726% 21	300000	284 483 €
CASINO 5,50%30/01/15	3650000	4 000 919 €
CASINO GP,6,375%13	5050000	5 495 307 €
CASINO GU 4,379%17	6000000	6 186 366 €
CATERP FINL 2,75%15	6674	5 392 635 €
CATERPILLAR 1,375%14	2655	2 070 439 €
CATERPILLAR 5,05% 16	2273	1 808 186 €
CATERPILLAR INTL	50	5 211 695 €
CB AUS 4,25 04/18	16880	18 142 469 €
CBAAU 4,375% 02-20	1700	1 826 152 €
CBS 5,90% 151040	9160	8 002 033 €
CBS CORP 4,3%02/2021	5500	4 454 156 €
CCCI 3,75% 01/15	1300	1 254 475 €
CDEL 4,75% 15/10/14	410	342 027 €
CDEP 4,25 09/16	8	714 796 €
CDP FINANC 4,4 19	764	640 782 €
CEFELEC 4,875%2021	2425	1 929 644 €
CEL ARAUCO 7,25 19	1085	1 024 369 €
CELLCO 5,55%09-2014	12300	10 532 005 €
CELLCO PART/VERI	8092	8 518 413 €
CENOVUS 6,75% 2039	1625	1 660 221 €
CENTERP EN 6,5% 18	1345	1 221 280 €
CENTURYLIN 6,45 21	3545	2 742 567 €
CEZ AS 4,875% 04/25	3700	3 812 409 €
CEZCO 5,75%05-15	500	568 522 €
CFF 3,375%06 EMTN	7290000	7 601 687 €
CFF4,875%05-21	20770000	22 931 244 €
CFSC 6,125% 02/2014	8800	7 663 829 €
CFSC 7,15 02/19	5200	5 221 257 €
CHEVRON 4,95 19	3000	2 768 628 €
CHOICE HOTEL 5,7%20	2000	1 640 780 €
CIE FIN,5,375%04-14	11750000	12 589 684 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
CIF 4,5%0614 EMTN	19320000	20 676 144 €
CIF EUROMORTGAGE	4900000	4 972 224 €
CISCO SYS 3,15 17	5000	4 208 154 €
CISCO SYS 4,45% 20	7400	6 592 397 €
CITIGROUP 3,95%13	3000	3 007 264 €
CITIGROUP 3,953% 16	29240	22 400 658 €
CITIGROUP 4% 11/15	4000	3 915 329 €
CITIGROUP 4,5% 2022	4000	2 960 484 €
CITIGROUP 4,75 15	12978	10 158 944 €
CITIGROUP 5%04-2014	15890	12 320 428 €
CITIGROUP 5%19EMTN	2200	2 198 339 €
CITIGROUP 5,3 12	2960	2 344 324 €
CITIGROUP 5,375% 20	6000	4 840 068 €
CITIGROUP 5,5 17	2230	1 764 531 €
CITIGROUP 5,5% 1014	6900	5 548 698 €
CITIGROUP 6,125 18	5000	4 071 471 €
CITIGROUP 6,40%13	500	537 088 €
CITIGROUP 6,625 32	1625	1 171 518 €
CITIGROUP 6,875%2038	7800	6 747 136 €
CITIGROUP 7,375%0614	12900	14 273 509 €
CITIGROUP 8,125% 39	3884	3 738 215 €
CITIGROUP TV17 S,B	400	339 301 €
CITIGROUP TV260230	2360	1 657 959 €
CITIGROUP7,375%04/19	1300	1 488 049 €
CITIGRP 4,75%19MTN	1850	1 556 451 €
CITIGRP INC 6,375%14	6800	5 625 771 €
CITY NATIONAL	1900	1 515 237 €
CL CAPITAL TVPERP,	3600	3 163 942 €
CLIFFS 6,25%011040	370	282 686 €
CLIFFS NAT 4,80% 20	2235	1 731 479 €
CM CIC COV 3125 0115	3000000	3 129 164 €
CM-CIC CBD 2,75% 14	21800000	22 441 944 €
CME GRP 4,4% 03/2018	8135	6 688 423 €
CME GRP IN 5,75 14	3980	3 400 357 €
CNA FIN 7,35% 1119	5530	4 689 272 €
CNA FIN CP 5,75% 21	9160	7 346 426 €
CNCEP 6,117%07-2017	2750000	1 587 604 €
CNCEP TV 4,625%07/15	1000000	590 466 €
CNP ASS,4,75%PERP,	3750000	1 697 202 €
CNP ASSUR 8,875 2041	600000	387 284 €
CO M 3,7% 01/06/15	9160	7 457 841 €
CO M 6,35% 06/2040	1425	1 339 295 €
COCA COLA 1,80% 0916	2390	1 882 249 €
COCA-COLA 2% 2016	2463	1 867 633 €
COCONO 4,6% 2015	2920	2 542 133 €
CODELCO 7,5 01/19	488	491 999 €
COF 5,5% 01/06/2015	6170	5 119 749 €
COM BK 5,5% 08-19	103	5 390 408 €
COM BK AUST 2,75% 12	735	574 664 €
COM BK AUSTRALIA	2400	2 550 736 €
COMCAST 5,85%15 SR	4000	3 519 928 €
COMCAST 5,90%16	8600	7 703 922 €
COMCAST 6,50%35 SR	3818	3 556 243 €
COMCAST 7,05% 03/33	3000	2 946 064 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
COMCAST CORP	12400	11 525 771 €
COMCAST CORP 5,7%19	2355	2 093 985 €
COMCAST CORP 6,55%39	3609	3 383 614 €
COMMERBK 4% 16/09/20	1500	1 392 123 €
COMMERZ4,75% 01/15	750	801 538 €
COMMERZBK 3,875% 17	440	446 698 €
COMMERZBK 6,375% 19	3071	2 338 548 €
COMMONLTH ED 1,95%16	7600	5 887 731 €
COMMONW,5,875%2020	5500	4 345 424 €
COMZBK AG 7,75 21	7	550 063 €
CON EDISON NY	9500	8 293 866 €
CONOCO FND 7,25 31	5200	5 542 914 €
CONOCOPHI,5 5/8%16	9160	8 345 208 €
CONOCOPHIL 5,2 18	3600	3 233 283 €
CONOCOPHIL 5,75% 19	2760	2 606 900 €
CONOCOPHIL 6,5%2039	4000	4 288 107 €
CONOCOPHIL 6,95 29	1160	1 223 863 €
CONSTELLAT,7,60%32	10725	10 899 509 €
CONT AIRLN 7,25% 21	605	460 399 €
CONTL AIRL 9%16	1345	1 061 158 €
CORIO NV 4,625% 18	2100	2 167 030 €
CORN PROD,3,2%10-15	2500	1 989 100 €
COVENTRY 5,45%11-21	5225	4 441 799 €
COVIDIEN FI 6,55%37	2100	2 078 863 €
COVIDIEN I 4,20 20	328	277 175 €
COVIDIEN I 6% 10/17	4039	3 728 147 €
COX 3,375%09-2039	12610	13 246 567 €
COX 5,45%04-2014	8810	7 556 542 €
CR,AGR,4,13 11/2015	1000000	653 839 €
CR,AGRIC,5,971%18	320	15 340 952 €
CR,AGRICOLE 6%13	75	4 001 975 €
CR,SUISSE 6 3/8%13	3400	3 627 093 €
CR,SUISSE GRP TV18	4840	4 542 887 €
CRED AGRI 3,9% 21	5950000	4 297 655 €
CRED SUISSE TV2020	1000	861 903 €
CRED,AGRIC,8,2% 2018	5100000	4 245 894 €
CRED,LOG,TV0617	8100000	6 986 844 €
CRED,LOGEMT PERP,	2900000	1 260 624 €
CREDIT 5,75%18 SUB	4600	3 575 317 €
CREDIT 5,875%06-19	131	5 862 954 €
CREDIT ARK 4,5 21	1500000	1 626 142 €
CREDIT LOG 5,454%21	4400000	4 050 617 €
CREDIT SUISSE LONDON	6300	6 686 170 €
CRH 3,30% 23/09/2022	3000000	2 862 561 €
CRH 7,375% 05/14	3500	3 968 727 €
CRH AMERIC 5,30% 13	1750	1 417 822 €
CRH AMERIC 6 09/16	3500	2 922 176 €
CROWN 5,495%10-2017	3650	3 059 371 €
CROWN CST 6,113 20	800	676 806 €
CS 3,875%01-2017	8900	9 335 037 €
CS GF 2,8750% 09/15	1100	1 102 632 €
CS NY 5,3 08/19	2095	1 695 669 €
CS NY 5,4 01/20	2945	2 190 874 €
CSFB 5,50% 08/2013	18160	14 888 432 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
CSSE AMORT,3,15%13	5391000	7 089 285 €
CSSE REFIN 2,6% 2016	21780000	21 985 008 €
CSSE REFIN5% 04-19	16860000	19 150 800 €
CSX 4,75% 2042	2095	1 659 721 €
CSX CO 7,375% 02/19	2280	2 247 709 €
CSX CORP 4,25% 21	5000	4 108 365 €
CSX CORP 6,15% 2037	2465	2 242 619 €
CSX CORP 6,25 18	3000	2 781 745 €
CSX CORP 6,25% 2015	7400	6 605 539 €
CVS CARE 5,75% 2041	4000	3 653 602 €
CVS CAREM 6,125 %39	6390	6 007 177 €
CVS CAREMARK 6,6%19	1200	1 138 016 €
CYTEC 6%05-2015	1250	1 067 189 €
CYTEC INDU 8,95% 17	4000	3 688 109 €
DAIMLER 4,625%09/14	8830	9 545 755 €
DAIMLER 7,875%2014	800	952 153 €
DAIMLER INT 6,125%15	50	2 873 118 €
DAIMLER NA 8,5% 2031	2100	2 318 904 €
DAIMLERCH,6,50%13	2920	2 461 975 €
DANAHER 3,9% 2021	1450	1 218 496 €
DANBNK TV 05-18	900	841 891 €
DANEMARK 4%15	52700000	8 121 294 €
DANEMARK 7% 10/11/24	10000000	2 144 690 €
DANSKE 4,75% 04/14	10038	10 486 831 €
DANSKE BK 3,875% 16	16285	11 673 481 €
DANSKE BK 4,75%12	3500	3 629 005 €
DARDEN 2,20% 2017	3600	3 219 994 €
DCP MIDST 4,75 21	5784	4 668 342 €
DCP MIDST 5,35% 20	1355	1 141 499 €
DEERE 2,95% 03/15	9700	7 949 962 €
DEERE 5,375% 2029	1390	1 355 379 €
DEERE CCJ 5,35% 2018	2175	1 986 206 €
DELTA AIRL 4,95% 19	4110	3 080 579 €
DELTALL 4,125% 2017	4200	3 970 864 €
DEU TELEKO 4,25 20	2300	2 474 591 €
DEU TELEKO 4,5% 30	500	493 520 €
DEU,BANK 5 1/8%13	2200	2 336 398 €
DEU,POST 4 7/8%14	4680	5 172 698 €
DEU,TEL,6 5/8%0318	2150	2 667 965 €
DEU,TELEK,8,25%30	5545	5 999 031 €
DEUT BK AG 4,875% 13	4600	3 650 442 €
DEUT,TEL,5,75%0114	3000	3 395 294 €
DEUTS TEL 5,875% 13	9160	7 618 973 €
DEUTSCH 8% 05/2099	1200	1 171 377 €
DEUTSCHE 4,25%16	5000	5 508 485 €
DEUTSCHE BK 6%17	1800	1 573 509 €
DEUTSCHE TEL 6%01-17	7130	8 585 375 €
DEUTSCHE TVPERP,	500	388 426 €
DEVON ENER 5,60 41	7300	6 841 743 €
DEXIA 3,125% 2015	19320000	18 731 657 €
DEXIA 3,875%16EMTN	19320000	18 945 208 €
DEXIA 5,375% 07/14	6350	5 582 064 €
DEXMA 3,75 05/16	9220000	9 201 542 €
DIAGEO CAP 5,2% 2013	2920	2 402 161 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
DIAGEOFIN 5,3% 2015	2500	2 206 780 €
DIAMOND 5,7% 2039	1565	1 354 153 €
DIGITAL 5,25%11-21	2100	1 651 701 €
DIGITAL 5 7/8%20	4900	4 060 820 €
DIREC HLDG 3,125%16	1300	1 024 414 €
DIRECTTV 3,55% 0315	4700	3 800 362 €
DIRECTV 3,5%11-2016	2500	2 004 638 €
DIRECTV 4,6%150221	5160	4 180 670 €
DIRECTV 5 03/21	4725	3 931 822 €
DIRECTV 6,375%11-41	5356	4 797 920 €
DISCOVER BK 8,7%19	7135	6 308 592 €
DISCOVERY 5,625%19	4600	4 113 385 €
DNB NOR7,068%PERP,	750	752 126 €
DNB NORBK 4,375% 21	6500	6 874 770 €
DOMINION 2,25%2015	9160	7 202 415 €
DOMINION 4,9% 2041	325	274 428 €
DOMINION 5%03-2013	2400	1 961 492 €
DOMINION RES 5,2%19	7255	6 550 444 €
DOMINIONRE 1,80 14	2140	1 684 669 €
DOMINIRES 6 11/17	2565	2 353 028 €
DONG DNK 4 12/16	450	483 429 €
DONG ENERG,3,50%12	4680	4 805 722 €
DOVER 5,375% 03/2041	1160	1 099 332 €
DOW CHEMI 7,375% 29	3900	3 826 447 €
DOW CHEMIC 4,125%21	3672	2 925 350 €
DOW CHEMIC 7,6% 14	2375	2 084 875 €
DOW CHEMICAL 4,5% 20	3405	2 733 035 €
DOW CHEMICAL 8,55%19	3900	3 950 252 €
DOW CHEMICAL 9,4%39	850	986 814 €
DR P 6,82000 05/18	8747	8 381 104 €
DRPEP 3,2% 11/2021	1155	894 894 €
DT 3,125% 2016	2920	2 295 704 €
DUKE 7,375% 15/02/15	7000	6 101 225 €
DUKE ENERG 3,95% 14	9160	7 605 508 €
DUKE ENERGY 3,35% 15	292	236 565 €
DUKE ENERGY 5,05% 19	2040	1 792 582 €
DUKE ENERGY CAR	9700	8 408 630 €
DUKE REALT 5,40% 14	3000	2 472 354 €
E,ETAT 1,60%JUIL15	241105000	293 831 506 €
E,ETAT 3%01 INDX	37430000	47 724 041 €
E,ETAT 3%05 OAT	18600000	19 612 020 €
E,ETAT 3,15%JUIL32	194490407	292 952 704 €
E,ETAT 3,40%99 OAT	130651499	203 951 611 €
E,ETAT 3,75%05 OAT	954810000	1 026 138 690 €
E,ETAT 4,25%03OAT	550730000	621 264 489 €
E,ETAT 4,75%04 OAT	4600000	5 545 091 €
E,ETAT 5%16 OAT	5500000	6 309 377 €
E,ETAT 5,50%98 OAT	6000000	7 663 676 €
E,ETAT 5,75%01	16170000	21 217 536 €
E,ETAT 6%94 OAT	48400000	62 328 036 €
E,ETAT 8,50%92 OAT	983210000	1 515 017 544 €
E,L,M,TV-PERP,	30	1 185 862 €
E,ON INTL 4,875% 14	400	444 414 €
E,ON INTL 6 3/8%17	1000	1 233 920 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
E,ON INTL FN 5,25%15	1000	1 132 956 €
EADS FINA 4,625 16	1000	1 103 863 €
EANDIS 4,50%2021EMTN	12	1 217 338 €
EATON CORP 5,6 18	2550	2 338 788 €
ECOLAB INC 2,375% 14	705	547 756 €
ECOLAB INC 3% 16	1000	795 992 €
ECOLAB INC 4,35% 21	2650	2 169 566 €
ECOLAB INC 5,5% 41	5283	4 242 720 €
EDENRED 3,625% 2017	16200000	15 982 822 €
EDF 4,6%10-27/01/20	4700	3 806 200 €
EDF 4,625 04/30	400000	400 012 €
EDF 4,625% 11/09/24	14350000	15 189 218 €
EDF 6,50%19	2600	2 339 535 €
EDF 6,95% 26/01/39	9160	8 557 797 €
EDISON 3,875% 2017	100	88 018 €
EDISON SPA 3250 0315	220	209 228 €
EDP FIN,4 ,125%0620	1400	1 090 196 €
EDP FIN,4,625%16	1100	939 373 €
EDP FIN4,75%26-09-16	1000	833 418 €
EDP FINANCE 3,75%15	1300	1 127 922 €
EIB 3,125% 04-14EMTN	25690	27 148 447 €
ELIA SYS,4,75%14	2000	2 177 837 €
ELSEVIER 6,5%04-13	95	5 237 559 €
EMBARQ 7,995%36 SR	9650	7 659 334 €
EMBRIDGE E,5,5%09/40	1700	1 457 837 €
EMP,ET,2,50%03OAT	174362300	216 765 853 €
ENBRIDGE 5,2% 03/20	2230	1 877 425 €
ENCANA 5,9%011217	6190	5 418 030 €
ENEL 3,5% 26/02/16	1500	1 466 202 €
ENEL 4,25%13 EMTN	1000	1 035 761 €
ENEL 5,25%200617	4680	4 824 198 €
ENEL FI 4% 09-16	1000	991 940 €
ENEL FI 6%07/10/2039	8960	5 620 119 €
ENEL FIN 5,75% 2018	9770	9 750 963 €
ENEL FIN 4,625% 2015	3567	3 614 328 €
ENEL FINA 3,875% 14	560	422 392 €
ENERG BAD W 7,375%72	1400	1 379 661 €
ENERGEN 4,625% 2021	2350	1 832 034 €
ENERGY 6,75%36	3400	2 843 401 €
ENI 4% 29/06/20215	270	282 891 €
ENI SPA 3,5% 2018	2750	2 795 821 €
ENI SPA 4,125%09-19	174	8 732 343 €
ENSCO PLC 3,25% 16	10860	8 577 746 €
ENSCO PLC 4,70% 2021	4575	3 670 610 €
ENTER PRODU 5,20% 20	15510	13 398 512 €
ENTERPRISE 3,7%10-15	350	278 520 €
ENTERPRISE 5,25%2020	2780	2 408 587 €
ENTERPRISE 6,125%39	5845	5 126 693 €
ENTR PRODU 6,45% 10	6200	5 666 144 €
EOG RESOURCES 2,5%16	7555	6 067 889 €
EON INTERNLE	1120	1 251 499 €
EON INTL F 5,8 18	2770	2 467 440 €
EON INTL FI 5,5%2016	6000	7 113 358 €
EPD 5,7% 02/2042	80	67 646 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
EQT CORP 8125 0619	3100	2 818 722 €
ERAC USA 5,8%12	9160	7 354 867 €
ERAC USA FINANCE	4390	3 435 066 €
ESE PRODT 3,20% 16	935	754 446 €
ESE PRODT 6,65 34	400	368 413 €
ESP 3,25% 04/16	11700	11 610 386 €
ESPAGN 3,3% 31/10/14	1000	999 991 €
ESPAGNE 2,3%09-2013	7000	7 016 363 €
ESPAGNE 3,80%0117	5000	5 078 795 €
ESPAGNE 4,1%300718	8000	7 975 516 €
ESPAGNE 4,2%310137	4000	3 283 333 €
ESPAGNE 4,65%10-2025	41740	38 711 086 €
ESPAGNE 4,7% 0741	6100	5 224 770 €
ESPAGNE 4,75%14	10400000	10 943 249 €
ESPAGNE 4,8%2024	8500	8 307 724 €
ESPAGNE 5,5%11-2021	4000	4 259 392 €
ESPAGNE 5,75%32	3500	3 530 843 €
ESPAGNE 6%29	14520	15 500 705 €
ESRX 3,125% 2016	2085	1 629 733 €
EUREKO 7,375%09-2014	6761	7 532 454 €
EUREKO TV 05/2049	95	680 167 €
EUROGRID 3,875% 2020	25	1 249 243 €
EUTEL 4,15% 03/2017	8500000	8 789 132 €
EUTLSAT SA 5% 19	4000000	4 066 707 €
EVI 7%38 SR	2140	1 910 496 €
EXELON 4% 10-2020	3500	2 788 713 €
EXELON GEN 5,20% 19	2650	2 262 999 €
EXPNL 4,75%02-20	2800	3 132 712 €
FAIRFAX FINL 5,8 21	7050	5 206 011 €
FBNETH 3,375%05-14	4540	4 859 158 €
FGA CAPITA 4%11-2013	1180	1 154 277 €
FHN CORP 5,375 15	6000	4 684 302 €
FIFTH THIR 3,62 %16	4500	3 472 419 €
FIFTH THIR 4,50 18	2500	1 921 362 €
FIFTH THIR 8,25% 38	4740	4 586 677 €
FIN,FON,3,75%0117	22460000	23 660 604 €
FIN,FONC,4,375%14	20100000	21 089 496 €
FINMECCAN 5,25 22	450	322 585 €
FINMECCAN 8,125 13	920	935 634 €
FINNISH GOV'T	20000	23 374 386 €
FIRST NIAG6,75%03/20	3145	2 601 196 €
FLORID PWR 6,4% 38	7100	7 370 654 €
FLORIDA PW 5,4 35	415	390 072 €
FLORIDA PW 5,95% 38	790	809 040 €
FLUOR CORP 3,375%21	1500	1 180 041 €
FNMA 0 09/10/19	1678	4 928 010 €
FONC,LYON,4,625%16	1800000	1 748 657 €
FORTIS 5,757%17	9000	8 552 440 €
FORTIS BANK TV21	1080	974 577 €
FORTIS BK 4 5/8%PL	168	4 963 386 €
FORTIS BK 4% 02/15	4750	4 992 451 €
FORTIS BK 4,375%17	1000	1 013 134 €
FORTIS BK 4,5%0514	1200	1 252 975 €
FORTIS BK TV170117	2545	2 504 276 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
FPL CAPIT 6,35% 66	1500	1 174 978 €
FRA,E,ET,4%0903OAT	12000000	12 778 315 €
FRA,TEL,5 5/8%18	6800	8 006 982 €
FRA,TELEC,8 1/8%33	2300000	3 220 615 €
FRANCE TE 2,125% 15	9160	7 022 867 €
FRANCE TE 3,375 22	500000	478 797 €
FRANCE TELE 4,125%21	2800	2 205 974 €
FRANCE TELEC 2,75%16	850	663 004 €
FRCE TEL 3,875%21	4500000	4 708 073 €
FREET MC 8,375 17	4665	3 869 181 €
FRTEL 4,125% 2019	800000	861 532 €
FRTEL8,5% 01/03/2031	5400	6 071 326 €
FTB MEMPHI 5,05 15	2500	1 967 892 €
GAS NAT 4,125 18	48	2 340 650 €
GAS NAT 5,375 19	37	3 746 261 €
GAS NAT 5,6250 17	10	1 070 632 €
GASSM 3,375% 01/2015	10	501 357 €
GASSM 5,25% 2014	113	5 910 952 €
GATX CORP 4,85% 21	7300	5 679 379 €
GATX CORP 8,75 14	2500	2 208 307 €
GAZ CAP,5,364%1014	5000	5 201 781 €
GDF SUEZ 3,125 20	36	3 567 158 €
GDF SZ 5,625% 01-16	3250000	3 834 001 €
GE 4,125%35 EMTN	2500	1 874 924 €
GE 4,65% 2021	4965	4 009 617 €
GE CAP 3,75% 04/16	750	788 637 €
GE CAP 5,5%09-2067	2100	1 689 283 €
GE CAP 6,025% 03/38	500000	568 753 €
GE CAP FUND2,875%15	3300	3 371 122 €
GE CAP,4 5/8%27	15	746 491 €
GE CAPIT 4,125%16	10000	10 465 366 €
GE CAPITAL 4,25%14	800	859 366 €
GE CAPITAL 4,35%21	1000	1 024 519 €
GE CAPITAL 5,25%15	2000	2 206 350 €
GE CAPITAL EUR FUND	244	14 341 732 €
GE EUR FUND 5,375%20	500	563 126 €
GEA GROUP 4,75% 2016	1000	1 054 669 €
GECAP TRUST 4,625%66	9080	7 180 978 €
GECC 1,875 09/13	688	538 457 €
GECC 2,25 11/15	2023	1 574 904 €
GECC 5,30% 02/2021	13740	11 516 355 €
GECC 5,9 13/05/14	1913	1 621 155 €
GECINA 4,25% 02/16	1500000	1 498 030 €
GECINA 4,5% 09/14	600000	605 301 €
GEN ELEC CAP 2,8%13	13015	10 320 457 €
GEN ELEC CAP 3,35%16	3000	2 412 745 €
GENERAL 5,625%18	23655	20 560 166 €
GENERAL 5,875%38	7100	5 862 248 €
GENERALI TVPERP,	10	353 113 €
GENWORTH 6,515%18	7585	5 483 325 €
GENWORTH 7,625%2021	1615	1 171 404 €
GILEAD 4,5%11-2021	5965	4 853 903 €
GILEAD SC 3,05%11-16	2845	2 235 412 €
GILEAD SC 4,40%11-21	805	655 519 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
GILEAD SC 5,65%11-41	9900	8 213 033 €
GILT 2 22/01/16	77000	9 755 807 €
GILT 2,25 07/03/14	60000	7 535 355 €
GILT 3,75 09/20	54000	7 551 785 €
GILT 3,75 09/21	23000	3 214 960 €
GILT 4 07/03/22	98000	13 991 455 €
GILT 4,25 07/12/27	60000	8 780 035 €
GILT 4,25 07/12/49	46000	6 971 005 €
GILT 4,25 09/39	38000	5 646 134 €
GILT 4,25 12/40	46000	6 785 454 €
GILT 4,5 07/03/19	59000	8 608 194 €
GILT 4,5 07/12/42	38000	5 874 232 €
GILT 4,75 07/12/30	68000	10 558 913 €
GL ELEC,6,75%32	15437	14 004 690 €
GLAXOS,5,65%18 SR	1020	952 461 €
GLENC FIN 7,125 15	47	2 642 237 €
GLENCORE 5,25% 03/17	20	1 038 811 €
GOLDMAN 3,70%10-2015	10085	7 731 199 €
GOLDMAN 4,375%10-17	4	193 799 €
GOLDMAN 4,5%230516	10	490 358 €
GOLDMAN 4,75%14	6000	6 221 200 €
GOLDMAN 5,35%16	7100	5 727 993 €
GOLDMAN 5,375%13	2000	2 100 710 €
GOLDMAN 5375 0320	23305	17 973 758 €
GOLDMAN 6,375%18	6900	7 340 652 €
GOLDMAN 6,45%36	7000	4 970 461 €
GOLDMAN 6,75%37	5115	3 748 928 €
GOLDMAN SAC 6,25%41	13145	10 108 168 €
GOLDMAN SACHS 4,5 16	464	456 083 €
GOLDMAN SACHS 6% 20	9160	7 224 678 €
GOODMAN 6,375% 2020	6150	4 852 248 €
GRP DELHAI 5,70 40	4025	3 191 956 €
GRUPO TV 6,625%2040	1625	1 457 281 €
GSACHS G 3,625% 16	7141	5 384 035 €
GSACHS G 6% 05/14	7675	6 198 056 €
GSACHS G 6,15% 18	2314	1 861 088 €
GSZFP 6,875%24/01/19	5650000	7 331 343 €
GUARDI 7,375% 09/39	1078	1 034 295 €
HALLIB 3,25% 2021	4000	3 188 149 €
HALLIBURTO 5,9 18	2705	2 532 607 €
HAMMERSON 4,875%15	1550	1 642 095 €
HANNOVER FI 5%06/49	5500	4 416 361 €
HARLEY-DAVID 6,8%18	7750	6 918 579 €
HARTFORD 5,5%10-2020	2800	2 203 164 €
HARTFORD 6,625% 0340	18460	14 158 951 €
HCP INC 6,75% 02/41	8260	6 783 434 €
HEALTH CARE 6%17	3000	2 537 606 €
HEALTH CARE 6,5% 41	2000	1 573 255 €
HEALTH SVC 4,70 21	1480	1 283 724 €
HENKEL 5,375% 2104	600	598 065 €
HERA 4,125%16	500	486 290 €
HERA SPA 4,5 % 19	1000	853 484 €
HESS 6 %15/01/40	3200	2 941 073 €
HESS CORP 5,6%10-41	8900	7 786 178 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
HESS CORP 7% 14	6880	6 002 155 €
HEWLETT 2,625%11-14	1805	1 402 876 €
HEWLETT-PACK 3,30%16	5700	4 471 930 €
HIT FIN BV 5,75 18	21	2 161 112 €
HIT FIN,4,875%1021	14	616 455 €
HOLLANDE 2,75% 01/15	7100000	7 699 533 €
HOME 5,875% 06-36	1721	1 667 638 €
HOME DEPOT 5,4% 16	6325	5 729 138 €
HOME DEPOT 5,95%41	6870	6 861 908 €
HONEYWLL 5,7 03/37	1230	1 169 484 €
HSBC 4 7/8%17	36	1 907 388 €
HSBC 4,5% 30/04/2014	14360	15 437 212 €
HSBC 4,875% 2022	8395	6 843 358 €
HSBC 5,1% 05/04/2021	2890	2 382 365 €
HSBC 6,1% 2042	3550	3 130 885 €
HSBC 6,25%18 SUBD,	60	3 234 848 €
HSBC 6,5%15/09/37	3745	2 936 143 €
HSBC BANK 3,5% 2015	4400	3 424 534 €
HSBC BANK 3,875% 18	2850	2 950 756 €
HSBC CAP FD TV-PER	6270	5 676 080 €
HSBC FCE 4,875%2014	2500000	2 731 427 €
HSBC FIN,3,75%15	4200	4 216 254 €
HSBC FINCE 6,676% 21	12400	10 023 255 €
HSBC HDG 6,8%0638	3250	2 609 396 €
HSBC TVPERP, REG-S	600	619 024 €
HSBC US 4,625%14	3000	2 408 106 €
HSBC USA 5% 27/09/20	6200	4 621 499 €
HSBCBANK 3,125% 17	1000	997 549 €
HSBCBANK 3,875 16	3000	3 195 231 €
HSBCBANK 4% 01/21	2100	2 216 139 €
HUSKY ENERGY 5,9%14	9160	7 689 996 €
HUTCHISON 4,75 16	296	15 636 035 €
HWLTT PCKD 4,65% 21	3000	2 424 262 €
HWLTT PCKD 4,75% 14	9400	7 653 609 €
HYATT HOTELS 5,75%15	1600	1 347 184 €
HYUNDAI SV 4,37% 16	6400	5 087 117 €
HYUNDAI SV 6% 15	9160	7 579 356 €
IBERDR FIN 3,5% 16	108	5 236 527 €
IBERDR SA 3,875% 14	4	413 969 €
IBERDROLA 3,80%2014	545	422 695 €
IBERDROLA 4,125%2020	67	3 247 712 €
IBERDROLA 5%11/09/19	9160	6 907 428 €
IBERDROLAC 7,5%11-15	100	5 630 184 €
IBESM 4,75% 2016	27	2 774 141 €
IBM 1,95% 2016	650	516 773 €
IBM 5,7% 14/09/17	8700	8 200 240 €
IBM 5,875% 11/32	1150	1 135 079 €
IBM 6,22% 08/2027	2625	2 677 836 €
IBM 6,50 01/28	1285	1 336 307 €
IBM 7,625%1018	13785	14 447 944 €
IMERYYS 5%180417	2000000	2 149 531 €
IMPERIAL 4,375%13	143	7 426 133 €
INBEV NV 4% 0418	1242	1 359 357 €
INBEV NV 8,625%01-17	15200	20 718 150 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
ING 3% 01/09/15	720	531 736 €
ING 3,25 03/03/16	14490	15 414 620 €
ING 4% 15/03/2016	3020	2 308 295 €
ING BANK 3,375%03-14	8220	8 820 384 €
ING BANK 3,875%11-16	10560	10 820 745 €
ING BANK 3375 0315	1500	1 542 899 €
ING BANK 5,50%12	1300	1 300 013 €
ING BANK TV19	3700	3 397 407 €
ING BANK TV290523	3240	2 898 494 €
ING BK 2% 18/10/2013	6250	4 695 791 €
ING BK NV 2,375% 14	5535	4 200 833 €
ING GROEP 4 1/8%16	100	100 997 €
INGERSOLL 6% 13	5000	4 205 657 €
INLT GAME 7,50% 19	6200	5 586 248 €
INT PAPER 7,5% 21	2500	2 429 052 €
INT PAPER 7,95%08-18	2990	2 796 177 €
INT,LEASE 6,50%14	322	258 872 €
INTESA 3,75%11-16	55	2 467 007 €
INTESA 3,875%15	52	2 517 692 €
INTESA 4,375% 2016	5	478 582 €
INTESA 5%23/09/2009	19	804 888 €
INTESA 9,5% 06/2016	14	520 097 €
INTESA SA 4,125% 16	3	290 724 €
INTESA SA 8,047% 49	88	3 029 545 €
INTESA SAN 6,50 21	325	204 814 €
INTESA SAN EUR3 2012	28	1 356 654 €
INTESA SAN PAOLO	156	7 779 094 €
INTESA SP 2,625%12	80	3 910 013 €
INTESA SP 6,625%2018	61	2 723 631 €
INTESA SPA 8,375%49	42	1 493 654 €
INTESA TV280518	112	4 667 656 €
INTL PAPER 4,75%2022	2000	1 630 293 €
IP 9,375%15/05/2019	1695	1 701 947 €
IPIC GMTN 4,875 16	800	854 311 €
ITALIE 2,25%10-2013	6000	5 748 156 €
ITALIE 3% 15/04/15	1000	929 709 €
ITALIE 3,75%010821	24250	19 937 785 €
ITALIE 3,75%16	5000	4 654 084 €
ITALIE 4%010217	11400	10 601 162 €
ITALIE 4,25%13	8000	8 087 090 €
ITALIE 4,25%13	14400	14 484 610 €
ITALIE 4,25%14	13100	13 047 683 €
ITALIE 4,25%15	6000	5 897 738 €
ITALIE 4,5% 03/2019	6000	5 435 420 €
ITALIE 4,50%010818	13000	11 973 339 €
ITALIE 4,50%20	6000	5 374 057 €
ITALIE 4,75%010823	32080	27 181 894 €
ITALIE 5%07-010839	3400	2 738 583 €
ITALIE 5%34	15765	12 738 683 €
ITALIE 5,25%010817	3000	2 943 376 €
ITALIE 5,75%33	42380	37 131 025 €
ITALIE 6%010531	49540	44 249 599 €
ITALIE 6,50%27	8000000	7 657 509 €
ITALIE 7,25%26	48400000	50 284 081 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
ITALIE 9%23	1500000	1 677 126 €
ITALIE TV150912	38000	41 602 644 €
ITALIE TV150914	2620	2 906 976 €
J P MORGAN 5,25%15	9000	7 403 665 €
JAPAN 0,5 20/03/15	14000	7 081 382 €
JAPAN 0,5 20/12/14	14000	7 072 996 €
JAPAN 0,6 20/09/14	14000	7 101 709 €
JAPAN 0,7 20/09/14	12000	6 104 242 €
JAPAN 0,8 20/03/14	12400	6 311 692 €
JAPAN 0,8 20/12/13	16000	8 116 770 €
JAPAN 1 20/09/20	9200	4 683 195 €
JAPAN 1,100 20	6000	3 078 731 €
JAPAN 1,2 20/06/15	36700	18 983 526 €
JAPAN 1,3 20/06/13	20000	10 188 268 €
JAPAN 1,3 20/12/19	8000	4 188 924 €
JAPAN 1,4 20/12/18	2000	1 058 696 €
JAPAN 1,5 20/06/19	10000	5 326 274 €
JAPAN 1,7 20/03/17	21700	11 659 589 €
JAPAN 1,7 20/09/16	10000	5 349 354 €
JAPAN 1,7 20/12/16	7000	3 738 807 €
JAPAN 1,8 20/06/17	8000	4 311 052 €
JAPAN 1,8 20/06/18	13000	7 045 808 €
JAPAN 1,9 20/09/30	10000	5 181 557 €
JAPAN 1,9 20/12/28	6400	3 334 051 €
JAPAN 2 20/12/25	9200	4 957 306 €
JAPAN 2% 20/12/2033	12720	6 590 839 €
JAPAN 2,1 20/03/26	3600	1 968 608 €
JAPAN 2,1 20/03/30	7400	3 961 455 €
JAPAN 2,1 20/09/29	6000	3 218 508 €
JAPAN 2,2 20/03/50	5600	2 883 117 €
JAPAN 2,3 20/03/39	4600	2 525 163 €
JAPAN 2,3 20/06/28	4000	2 208 681 €
JAPAN 2,3 20/12/35	3200	1 748 010 €
JAPAN 2,3 20/12/36	5000	2 732 617 €
JAPAN 2,5 20/09/37	5000	2 846 466 €
JAPON 0,7% 20/06/14	10000	5 073 326 €
JAPON 1,3% 20/03/19	14000	7 384 098 €
JAPON 1,50%17 289	20000	10 633 224 €
JAPON 1,70%17	6000	3 233 852 €
JAPON 2%10-2040	4600	2 364 128 €
JAPON 2,1%24 E,74	12000	6 577 972 €
JAPON 2,2%26 E,90	14600	8 060 617 €
JAPON-99 2,1% 1227	16000	8 619 568 €
JEFFERIES8,50% 2019	8000	6 411 972 €
JOHN DEERE 2%2017	5000	3 914 720 €
JOHNSON 3,75%12/2021	5970	4 532 929 €
JOY GLOBL 5,125%21	7000	5 860 349 €
JP MORGAN 4 3/8%21	40	1 683 793 €
JP MORGAN 4,375%19	139	6 172 541 €
JP MORGAN 6 1/8%17	5891	4 976 860 €
JP MORGAN 6%011017	15950	13 325 536 €
JPM 3,15% 2016	5690	4 468 931 €
JPM 3,75% 2016	1815	1 875 710 €
JPM 4,625% 2021	6700	5 342 646 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
JPM 5,40%06/01/2042	6900000	5 458 292 €
JPM 6,45%02/02/2037	7700	6 051 003 €
JPM 7%01/11/2039	6200	4 845 571 €
JPM 7,9% 2018	3955	3 272 165 €
JPM CHASE 6 07/17	9300	7 907 889 €
JPMORGA 25 6,8% 37	2815	2 210 945 €
JPMORGAN 4,3/8%14	30	1 601 720 €
JPMORGAN 5,25%13	60	3 207 749 €
JPMORGAN 5,25%15	14	779 598 €
JPMORGAN 5,5%10-2040	248	200 442 €
JPMORGAN 5,60%2041	4000	3 308 259 €
JPMORGAN 6,125%04-14	414	23 031 508 €
JPN 0,1 15/01/14	30000000	300 144 €
JPN 0,1 15/09/13	4000	2 002 091 €
JPN 0,2 15/01/13	4900	2 457 133 €
JPN 0,2 15/05/13	20000	10 023 768 €
JPN 0,2 15/11/13	12000	6 016 604 €
JPN 0,3 20/09/15	8000	4 014 743 €
JPN 0,4 20/06/16	10000	5 024 601 €
JPN 0,5 20/03/16	15000	7 583 140 €
JPN 0,5 20/12/15	15400	7 777 135 €
JPN 0,8 20/03/13	4000	2 023 335 €
JPN 0,80 13 N247	10200	5 159 554 €
JPN 1 20/09/21	12000	6 042 195 €
JPN 1,1% 20/12/21	270000000	2 731 877 €
JPN 1,2 20/06/21	12000	6 147 856 €
JPN 1,2 20/12/20	9200	4 738 733 €
JPN 1,3 20/03/21	12000	6 236 115 €
JPN 1,60 13 N253	8000	4 123 695 €
JPN 1,60 14 N,260	8000	4 148 689 €
JPN 1,7% 20/12/31	240000000	2 382 214 €
JPN 1,8 20/09/31	10000	5 079 182 €
JPN 1,90 06/14	23480	12 263 302 €
JPN 1,90 09/22 N58	19780	10 786 990 €
JPN 2,1 20/03/25	4600	2 530 020 €
JPN 2,1 20/12/30	10000	5 313 341 €
JPN 2,10 12/21 N53	4000	2 214 523 €
JPN 2,3 03/35 N,18	3200	1 757 420 €
JPN 2,3 20/06/27	6000	3 324 525 €
JPN 2,30 09/18 N40	24560	13 791 879 €
JPN 2,4 20/03/48	9300	5 097 122 €
JPN 2,60 03/18 N39	12000	6 829 540 €
JUNIP NETW 4,60 21	1635	1 333 476 €
JUNIPER NET 5,95%41	2000	1 724 812 €
K FOODS 6,875% 2039	2000	2 096 431 €
KBC 5%11-2016 EMTN	64	3 121 229 €
KBC IFIMA 3,875 15	2500	2 364 922 €
KBC IFIMA 4,37 15	1000	927 487 €
KBC IFIMA 4,50% 0914	4000	3 834 687 €
KELLOGG 4,45% 05/16	9160	7 835 905 €
KENT UTILI 5,125%40	2505	2 301 387 €
KEYCORP 3,75% 2015	7000	5 670 407 €
KEYCORP 5,10% 21	4000	3 241 740 €
KEYCORP 6,50%13 SR	14795	12 148 354 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
KFT 5,375%10/02/2020	14220	12 802 162 €
KFW 3,125 06/18	2000	2 159 325 €
KINDER MORG 6,85% 20	3000	2 766 574 €
KINDER MORG 3,5% 16	10715	8 684 072 €
KLEPIERRE 4% 10-2017	16400000	16 395 261 €
KLEPIERRE 4,25%16	1500000	1 564 379 €
KMP 5,625%15/02/2015	8800	7 591 026 €
KMP 6,5%01/09/2039	10110	8 724 943 €
KOHL 4%11-2021	3185	2 528 583 €
KOHL 6%02-2033	8600	7 580 127 €
KON,KPN 4,75%14	400	435 461 €
KON,PHILIP,5,75%18	1900	1 700 338 €
KONIN,KPN 4,75%17	14360	16 196 906 €
KPN 6,25% 04/02/14	400	455 953 €
KPN 6,5%150116	1200	1 446 349 €
KPN 7,50% 04/02/19	2700	3 494 286 €
KRAFT 5,75%12	4350	4 583 117 €
KRAFT 6,125%18 SR	800	737 557 €
KRAFT 6,25%15	1600	1 855 091 €
KRAFT 6,5%17 SR	2035	1 896 725 €
KRAFT 6,50%31	6390	6 159 124 €
KRAFT 6,875%38 SR	7975	8 303 834 €
KREDITANS,3,50%15	24250	26 490 594 €
KROGER 6,9% 04/38	6160	6 059 556 €
KROGER 7,5%01-2031	3900	3 896 801 €
LA POSTE 4,25%21	3095000	3 211 957 €
LABORATORY 3,125%16	9625	7 662 881 €
LANXESS 4,125% 2018	1800	1 894 160 €
LEASEPL C 3,875 15	750	752 330 €
LEASEPLAN 3,75%2013	500	517 629 €
LEGAL TV25 EMTN	6850	5 756 540 €
LEGRAND 4,25% 02/17	1300000	1 381 382 €
LEGRAND 4,375% 2018	2400000	2 526 590 €
LEXMARK 6,65%08-2018	3900	3 346 862 €
LIBERTY 5%11-2021	2565	1 924 547 €
LIFE TEC 3,50%2016	3123	2 461 956 €
LINCOLN 4,85% 2021	3150	2 433 758 €
LINCOLN 6,05/TV 67	1495	973 104 €
LINCOLN 6,25 02/20	9160	7 814 379 €
LINCOLN 8,75%09-2019	1834	1 713 776 €
LINDE FI,4,75%0417	5000	5 745 871 €
LINDE FIN 3,125%15	3746	3 891 958 €
LINDE FIN 3,875%21	690	746 963 €
LINDE FIN, 6% 2049	400	422 775 €
LINDE FIN,TV140766	4700	5 193 836 €
LLOYD TSB 3,375% 15	1300	1 255 323 €
LLOYD TSB 4,875% 16	7000	5 393 930 €
LLOYD TSB 3,75 15	3900	3 732 739 €
LLOYDS 5 7/8%14	3000	2 915 350 €
LLOYDS 5,375%09-19	600	590 546 €
LLOYDS 5,8% 01/2020	1250	939 147 €
LLOYDS 6,25% 04-14	800	856 482 €
LLOYDS 6,375%062016	9100	9 700 056 €
LLOYDS BK 3,25% 2012	14775	14 812 279 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
LLOYDS BK 4,125% 16	19564	20 807 849 €
LLOYDS TSB 6500 0320	1250	1 042 203 €
LLOYDS TSB BANK 0315	1650	1 712 483 €
LLOYDS TSB BK 4,5%14	5000	4 989 088 €
LLOYDS TV050318	500	398 658 €
LORILLARD 3,5%3,5%16	2800	2 207 094 €
LOTTOMATIC 5,37 18	10	460 390 €
LOUISV GAS 1,625% 15	2572	1 985 801 €
LOWES 3,8% 2021	1150	933 135 €
LVMH 3,375 04/15	4300000	4 605 867 €
LVMH 3,375% 2012	4680000	4 811 572 €
LVMH 4 06/04/2018	600000	663 892 €
M&I MARSH 4,85% 0615	7032	5 671 128 €
MACQUARIE 6,625%2021	2700	1 897 925 €
MAGELL MID 6,4 18	1760	1 656 700 €
MANULIFE 3,4%10-15	8404	6 575 768 €
MARATHON P 6,50% 41	10045	8 830 333 €
MARSH 5,75% 0915	273	467 868 €
MASS MUTL 8,875% 39	1564	1 772 042 €
MATTEL 5,625% 03/13	6900	5 671 879 €
MCKESSON 5,7% 2017	9160	8 358 059 €
MCKESSON 7,5%09-2019	360	363 233 €
MDC HLDGS 5,625% 20	6500	4 787 460 €
MEDCO 7,25%13 SR	4580	3 903 065 €
MEDCOHEAL 6,125 13	4580	3 782 346 €
MEDIOBCA 4,375% 12	2200	2 292 141 €
MEDTRONIC 2,625%2016	2000	1 605 327 €
MERCK FIN 3,375%2015	10075	10 725 975 €
MERCK FIN 4,5%10-20	1000	1 105 404 €
MERCK NEW 5,85% 39	2750	2 724 432 €
MERCK&CO 5%09-2019	7100	6 480 599 €
MERIL LYNCH 6,22%26	4700	3 040 528 €
MERR LYNCH 5,7% 2017	1480	1 059 994 €
MERRILL 4 5/8%13	1000	974 008 €
MERRILL 4 7/8%14	20	980 510 €
MERRILL 6,75%13	234	12 178 052 €
MERRILL 7,75%38	1683	1 184 704 €
MERRILL L,4 5/8%18	500	372 727 €
MERRILL TV 2012	2500	2 444 511 €
METLIFE 5% 24/11/13	9160	7 562 366 €
METLIFE 6,50 12/32	3153	2 872 044 €
METLIFE 6,75%16 SR	1875	1 670 728 €
METLIFEINC6,4% 1236	11570	8 396 920 €
METRO 4,25% 2017	2000	2 136 869 €
METRO 7,625 03/15	1300	1 557 792 €
METROFIN 9,375 11/13	1000	1 135 647 €
MICHEL LU 8,625 14	2050	2 449 304 €
MICROSOFT 2,5% 2016	7500	6 186 598 €
MIDAM NRJ 5,8%06-36	2055	1 921 896 €
MIDAMER 6,5 09/37	2170	2 117 264 €
MIDAMER,6 1/8%36	8238	7 646 535 €
MONSANTO5,875% 04/38	5000	4 975 706 €
MONTE PAS 4,75%2014	80	3 943 502 €
MORG 4,50% 02/2016	1840	1 762 657 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
MORG 5,375% 08/20	18	811 240 €
MORG 5,625% 09/2019	8350	6 045 236 €
MORG 5,75% 01/21	537	394 595 €
MORGAN 5,50%021017	1500	1 396 100 €
MORGAN C&C 3,45% 16	9160	7 229 905 €
MORGAN C&C 3,7 15	2220	1 792 135 €
MORGAN C&C 4,35 21	5000	3 947 812 €
MORGAN C&C 6,3% 19	1022	900 666 €
MORGAN C&C 6,4% 38	5430	4 822 089 €
MORGAN INC 4,2 14	9000	6 724 026 €
MORGAN ST 4,5%10/14	141	6 819 942 €
MORGAN ST,3,75%13	5000	5 049 479 €
MORGAN ST,4 3/8%16	1900	1 732 194 €
MORGAN STAN 6%04-14	8116	6 350 448 €
MORGAN STAN 7,3%19	6368	5 013 815 €
MORGAN STAN FRN 14	610	433 320 €
MORGAN STANLEY 4%15	7000	5 148 725 €
MOSAIC 3,75%15/12/21	605	471 045 €
MOSAIC 4,875% 41	645	510 196 €
MOTABILITY 3,75 17	400	417 126 €
MOTOROLA 6% 11/17	2500	2 143 827 €
MOVIL SAB 5,625 17	2645	2 353 415 €
MOVIL SAB 6,375 35	3120	2 974 361 €
MS 3,8% 2016	20165	14 380 511 €
MS 5,5%26/01/2020	10665	7 713 591 €
MTVD 5,75%15/01/2020	6900	6 295 110 €
MUNC,RUCK,TV PERP,	210	8 508 350 €
NAB 4,625%10-20	3000	2 994 815 €
NAB 4,75%07-16	1000	1 086 922 €
NABISCO 7,55 06/15	576	526 464 €
NABORS INDUSTRIES 6,	1300	1 144 641 €
NASDAQ OMX 5,25% 18	6900	5 683 066 €
NAT AUS BK 3,75 17	645	672 987 €
NAT AUS BK 4 20	7100	7 296 497 €
NAT RURAL 5,45 17	6250	5 515 905 €
NATGRID US 3,25 15	3310	3 454 751 €
NATION IN 9,375 39	9160	8 659 791 €
NATIONAL 4,125%13	1600	1 698 771 €
NATIONAL 5,50%15	5000	5 589 563 €
NATIONWIDE 3,75%2015	6150	6 267 195 €
NATIONWIDE 5,375%21	7550	5 803 888 €
NATIXIS 4,125% 17	4000000	3 719 447 €
NATIXIS TV0519EMTN	5600000	4 753 803 €
NATIXIS TV17	1000000	893 143 €
NATIXIS TV260117	13050000	12 713 361 €
NATL GRID 6,5%04-14	74	4 242 206 €
NATL RURAL 5,50 13	3800	3 131 995 €
NATWIDE BS FRN 20	620	520 226 €
NBC UNIVER 2,10% 14	5285	4 138 906 €
NBC UNIVER 2,87% 16	10340	8 184 682 €
NBC UNIVER 4,37% 21	3200	2 639 007 €
NBC UNIVER 5,15% 20	2400	2 075 247 €
NBC UNIVER 5,95% 41	545	504 778 €
NBC UNIVER 6,40% 40	660	626 160 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
NBHSS 4,5%03-20	1600	1 480 589 €
NBL 8,25% 03-19	6100	6 242 738 €
NEDERLAND 1 01/14	4800000	4 900 157 €
NEDERLAND 1,75 13	8200000	8 470 867 €
NEDERLAND 2,5 17	3500000	3 723 082 €
NEDERLAND 3,25 21	3800000	4 200 072 €
NEDERLAND 3,75 42	3100000	4 053 002 €
NEM 6,25%01/10/2039	7300	6 690 762 €
NETHER GOVT 4%2019	7400000	8 602 775 €
NEW YORK 4,3/8%17	98	5 413 334 €
NEW YORK LIFE	1353	1 340 418 €
NEWMONT 5 7/8%35	2300	2 004 106 €
NEWS 6,15%37 SR	7000	5 961 337 €
NEWS AMER 5,3% 2014	9160	7 722 195 €
NEWS AMER 6,15 41	5855	5 262 896 €
NEWS AMER 6,2%04-34	995	819 363 €
NEWS AMER 6,65%2037	5700	5 003 642 €
NEWS AMER 6,9%09-19	4130	3 822 763 €
NEWS HLDGS 9,25 13	3400	2 927 694 €
NEXEN 7,5%09-2039	2860	2 749 657 €
NEXEN INC 6,4% 37	1000	823 179 €
NIAGARA 3,553%09-14	2170	1 754 451 €
NIF 6,125%01/03/2022	5500	4 957 105 €
NOBLE ENERGY 4,15%21	7885	6 231 089 €
NOBLE ENERGY 6% 2041	3040	2 721 997 €
NOBLE HLDG 3,05% 16	2400	1 899 481 €
NOBLE HOL 4,9% 2020	6000	5 008 142 €
NOMURA 5,125 12/14	2000	2 038 561 €
NOMURA HLDS 5% 2015	9160	7 228 700 €
NORDEA AB 2,125% 14	2300	1 747 952 €
NORDEA AB 3,625% 16	2300	2 423 317 €
NORDEA AB 4,875 21	8875	5 790 085 €
NORDEA AB 4,875% 20	480	385 969 €
NORDEA ABB 4% 03/21	13703	11 983 142 €
NORDEA BK 2,50%12	5000	3 877 144 €
NORDEA BK 3%08-12	9640	9 828 337 €
NORDEA BK 3750 0217	1900	1 994 982 €
NORDEA BK 4,5%09-14	2300	2 470 888 €
NORDSTROM 7%07-2038	3500	3 616 202 €
NORFOLK 4,837%11-41	746	624 124 €
NORFOLK 7,25% 01-31	6783	7 349 973 €
NORTH BORD 3,25% 16	9160	7 362 168 €
NORTHERN 3,625%13	5590	5 798 788 €
NORTHGROUP 6,378%49	430	299 922 €
NRW BK 3 7/8%20MTN	12120	13 759 208 €
NSANY 4,50%01-15	5500	4 470 074 €
NSC 5,9% 15/06/2019	3200	2 989 404 €
NYSE EUNEX 4,8 13	7000	5 668 911 €
OAT 1% 2005-2017	374294701	419 773 514 €
OAT 2,5% 25/10/20	8000000	7 700 078 €
OAT 3,25 25/10/21	10000000	10 143 246 €
OAT 3,5 25/04/26	13100000	13 413 085 €
OAT 3,5%AVRIL 2015	12000000	13 060 435 €
OAT 3,50% 25/04/20	1808540000	1 923 037 975 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
OAT 3,75% 25/10/2019	4600000	4 919 123 €
OAT 4% AVRIL 2055	73850000	80 101 370 €
OAT 4,25% 25/10/2018	2500000	2 771 311 €
OAT 4,5% 0441	5000000	5 912 848 €
OAT1,3% 07/2019	135540720	143 542 450 €
OAT2,10%08-23 INDX	169348000	195 570 481 €
OAT3,25%06-16	3000000	3 242 564 €
OAT3,75%07-17	14500000	16 014 447 €
OAT4%06-38	6000000	6 407 697 €
OAT4%08-18	520550000	580 949 189 €
OAT4,25%07-23	750420000	824 662 455 €
OATE1,80%07-40 IND	132479840	155 326 101 €
OATE2,25%04-20 IND	400819986	512 895 798 €
OATei 1,85% 07/27	68357000	74 074 635 €
OATI 1,1% 072022	182955787	187 974 905 €
OBLI 5,9 30/07/26	1000	1 036 620 €
OCC PETRL 4,10% 21	1550	1 340 549 €
OGLETH 5,25% 2050	2000	1 915 225 €
OHIO 5 3/8%011021	1280	1 147 164 €
OHIO E 6,875% 07/36	2105	1 969 403 €
OLD MUTUAL 4,5%17	1	51 524 €
OLO 4,25 28/03/41	700	718 197 €
OLO58 3,75 09/20	6000000	5 969 286 €
OMAHA 6,95% 2040	7000	6 520 112 €
OMNICOM 4,45% 2020	5500	4 382 384 €
OMV AG 4,25% 10/21	1850	1 961 692 €
ONCOR ELEC 6,8% 18	4600	4 391 378 €
ONEOK 8,625% 03/19	3035	3 048 486 €
ONEOK INC 6% 06/2035	4300	3 555 753 €
ONEOK PART 6,65%36	750	702 103 €
ORACLE 5,375% 2040	2229000	2 121 143 €
ORACLE 5,75 04/18	2920	2 751 548 €
ORIX 5% 12/01/2016	6000	4 919 468 €
OXY 1,75% 2017	8885	6 912 677 €
PAC LIFE 9,25%39	1567	1 613 281 €
PAC,GAS 6,25%39 SR	7100	7 156 300 €
PACIFIC GAS 4,8%14	4500	3 781 948 €
PASO NATGAS 5,95% 17	2840	2 482 292 €
PASO NATL 8,625% 22	875	881 578 €
PAYS BAS 3,5% 07/20	1500000	1 692 171 €
PAYS BAS 3,75%14	7600000	8 337 925 €
PAYS BAS 5,50%28	3150000	4 524 857 €
PAYS-BAS 3 3/4%23	7100000	8 315 164 €
PAYS-BAS 4%150716	9100000	10 392 811 €
PAYS-BAS 4%150718	5400000	6 227 156 €
PAYS-BAS 4%2037	42270000	55 464 772 €
PEMEX 6 3/8%16REGS	1300	1 442 487 €
PENTAIR 5 05/21	1360	1 097 382 €
PERKINELMR 5%21	1750	1 396 877 €
PETROHAWK 7,875%15	2524	2 084 640 €
PFIZER 3,625% 06/13	94	4 942 447 €
PFIZER 6,2% 03/19	450	433 595 €
PFIZER 7,20% 03/39	8150	9 259 749 €
PFIZER INC	18300	16 173 391 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
PHILIP INT 5,65% 18	2030	1 858 655 €
PHILIP MORRIS	4000	3 533 736 €
PHILIP MORRIS	16	930 147 €
PL 7,375%15/10/2019	6400	5 550 598 €
PLAINS 5,75% 2020	9160	8 157 163 €
PLUM CREE 4,70% 21	1760	1 393 535 €
PNC 4,9%15/01/2015	4600	3 908 770 €
PNC FUND 5,25%2015	3000	2 495 962 €
PNC FUND,4,375%20	6160	5 166 525 €
PNC FUNDING 6,7%19	3250	3 038 624 €
PNC PFD FD 6,517%49	55	3 022 583 €
POHJOLA BA 3 17	3000	2 955 726 €
POTASH SAS 5,25% 14	640	543 574 €
PPG INDS 3,60% 20	3500	2 823 752 €
PPL ELEC 3% 2021	1050	823 538 €
PPL ENERGY 6,5% 2018	2500	2 204 158 €
PPR 3,75% 04/2015	2500000	2 627 641 €
PRICOA GLO 5,45 14	2125	1 763 203 €
PRIDE INT 6,875% 20	4400000	4 038 548 €
PROCTER 4 7/8%27	5970	7 160 124 €
PROG ENER 3%11-2021	3000	2 291 105 €
PROGRE 6,7% 2037	1500	1 171 086 €
PROGRS NR 4,875% 19	1965	1 703 518 €
PROLOGIS 5 5/8% 11-1	4700	3 752 130 €
PROLOGIS 7,625% 11-1	3800	3 253 888 €
PROTC LIFE 8,45% 39	1250	1 115 172 €
PRU 3,875%14/01/2015	2250	1 828 959 €
PRU FI4,75%17/09/15	12100	10 000 797 €
PRUD 4,50% 2021	2500	1 942 632 €
PRUDEN 5,625% 2041	510	387 275 €
PRUDENT 7,575% 2019	1825	1 662 016 €
PRUDENT 8,875% 68	2920	2 569 506 €
PRUDENT FI 4,5% 2020	4000	3 133 708 €
PRUDENT FI 5,7% 36	1471	1 117 591 €
PRUDENT FIN 3% 2016	460	354 820 €
PRUDENTIAL 3,625%12	768	606 286 €
PRUDENTIAL 6,2% 2015	4580	3 958 851 €
PS COLOR 3,20% 20	1690	1 355 939 €
PUBLIC SERV 4,75% 41	4405	3 914 152 €
PX 4,5%15/08/2019	4700	4 167 240 €
QUEST DIAG 4,7% 21	2090	1 728 414 €
QUEST DIAG 5,75%2040	6190	5 259 770 €
QWEST COR 8,375% 16	5000	4 449 801 €
QWEST CORP 6,5% 2017	3010	2 546 880 €
QWEST CORP 7,5 %14	1061	910 730 €
RABOBANK 3,5% 10/18	4720	4 776 143 €
RABOBANK 3,75% 2020	1000	886 098 €
RABOBANK 4,125% 2021	16380	17 494 592 €
RABOBANK 4,125% 25	7850	8 051 672 €
RABOBANK 4,125%2020	5800	6 230 359 €
RABOBANK 4,2%09-14	7400	5 962 352 €
RABOBANK 4,375%09-16	2000	2 179 253 €
RABOBANK 4,75%0118	17600	19 803 845 €
RABOBANK 4,75%0622	3000	3 308 951 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
RABOBANK TF11%/TV 49	1160	1 047 076 €
RABOBK 4,375%01-14	7650	8 350 682 €
RABOBK 5 7/8% 05/19	5150	5 532 227 €
RABOBK 5,25% 41	3000	2 269 142 €
RB SCOTLD 3,4%10-13	1960	1 490 959 €
RB SCOTLD 4,875 14	5000	3 829 721 €
RB SCOTLD 6,4 19	6000	4 368 500 €
RBS 4,375% 2016	7000	5 201 822 €
RBS 4,75% 1016	3000	2 943 719 €
RBS 5,5%10-23/03/20	3000	2 916 385 €
RBS GRP PLC 5,375%19	8050	7 590 251 €
RBSA 4,875% 16/03/15	4265	3 206 980 €
RCI 4 11/07/13	1620000	1 660 280 €
RCI 4 16/03/16	3500000	3 368 019 €
RCI 4,375 01/15	1950	1 992 029 €
RCI 5,625 10/15	17571000	17 904 246 €
RCI BANQUE 3,75 2014	3429000	3 408 406 €
RCI BANQUE 3,75% 14	7514000	7 575 182 €
RCI TF 05/12	500	535 003 €
REALTY INCOME	7000	5 870 440 €
RED ELEC 3,50% 10/16	34	1 698 931 €
RED ELECT 4,75% 18	22	2 370 574 €
RED ELECTR,4,75%13	1400	1 467 741 €
REN RED 6,375% 12-13	44	1 967 128 €
REP OF POL 5% 03/22	5000	3 898 791 €
REPSOL 4,25% 16	74	7 471 692 €
REPSOL 5%13 SR	110	1 156 515 €
REPSOL INT,4,75%17	4390	4 705 527 €
REPU SVCS 5,25% 21	1425	1 248 775 €
REPUBLIC 5,5%19	1550	1 383 840 €
REPUBLIC 5,70%11-41	7585	6 737 623 €
REPUBLIC SV 6,2%40	1850	1 730 301 €
REXAM 4,375%13	1400	1 481 414 €
REYNOLDS 7,625%06/16	16030	14 824 226 €
RHOM HASS 6% 2017	5800	5 135 545 €
RIO 7,125%0728 SR	1430	1 510 751 €
RIO TINTO 3,5%20	7000	5 530 322 €
RIO TNNT0 9% 2019	6315	6 662 223 €
RIOTIN FI 5,875% 13	3250	2 726 450 €
RIOTIN FIN 8,95% 14	9735	8 861 853 €
ROBERT 5,125%06-17	50	2 949 089 €
ROCHE 5,625% 03-16	4650	5 568 462 €
ROCHE HD 6% 01/03/19	5685	5 401 932 €
ROCHE HLDG 5 14	10310	8 747 246 €
ROCHE HLDG 7%09-39	1825	2 026 895 €
ROGERS CAB 6,75% 15	5095	4 575 129 €
ROPER 6,625%08-2013	2300	1 952 172 €
ROPER INDS 6,25 19	5000	4 618 719 €
ROYAL BK 4,35%17	20	778 336 €
ROYAL BK 5,25%13	1300	1 343 141 €
ROYAL BK 5,75%05-14	7300	7 568 711 €
ROYAL BK 6%13	1350	1 323 689 €
ROYAL BK SC 6,934%18	4000	3 394 010 €
ROYAL BK SCOTLND	5750	5 702 062 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
RTE 3,875 06/22	300000	307 343 €
RWE 4,625% 20	1600	1 499 174 €
RWE 5% 10-15	500	569 196 €
RWE FINAN,4 5/8%14	500	546 695 €
RYDER SYS 3,15% 2015	7000	5 587 612 €
RYDER SYS 7,2% 15	2500	2 323 255 €
SAFEWAY 7,25 02/31	9160	8 553 773 €
SAMBILLER 4,5% 01/15	2200	2 429 278 €
SAN DIEGO 4,5%0840	670	577 838 €
SANDVK 6,875%02-14	1350	1 556 085 €
SANOFI 2,625%11-2016	1360	1 097 289 €
SANOFI 3,125% 2014	14580	15 305 251 €
SANOFI AV 4% 11-2021	805	686 951 €
SANPAOLO IMI TV20	368	13 706 296 €
SANT INTL 3,50% 14	230	11 302 845 €
SANT,ISSUAN,TV1017	80	3 104 743 €
SANTAN US 2,991% 13	70	5 197 580 €
SANTANDER 3,381% 15	101	9 378 363 €
SANTANDER 4,375%15	18	1 857 714 €
SANTDEBT 3,75% 2013	40	4 095 717 €
SANTDEBT 4,50 15	50	5 034 208 €
SAPRR 4,375 01/16	66	6 665 568 €
SAPRR 4,875% 01/19	2000000	2 023 971 €
SBC CIONS 5 7/8%12	1489	1 207 067 €
SCANA 4,75% 2021	2275	1 855 829 €
SCHLMB NOR 4,20% 21	2303	1 978 424 €
SCHLUMB FI 2,75% 15	750	776 808 €
SCHNEID,5,375%0115	1700000	1 952 605 €
SCHNEIDER 3,75% 18	2400000	2 519 839 €
SCOR 6,154%06PERP,	2500000	1 929 832 €
SCOTTISH & SOUTH	9450	8 840 882 €
SCOTTISH 6,125%2013	3750	4 111 795 €
SD CHARTERED 5,75%14	800	881 871 €
SEB 3,75% 2016	550	564 914 €
SEB AB 4,25 02/18	2000	2 093 562 €
SEMICDT 3,95% 15	3000	2 507 175 €
SEMPRA 9,8% 15/02/19	815	878 808 €
SEMPRA ENERGY 6%39	7100	6 767 515 €
SES 4,75%11-2021	600	639 909 €
SEGLX 4,625%03-20	7840	8 414 485 €
SEGLX4,875%07-14	1200	1 304 739 €
SG 3,125 21/09/17	80	3 717 181 €
SG 5,125% 19/12/2013	40	2 049 701 €
SG TV07-17 EMTN	200	8 582 194 €
SHBASS 3,125% 2016	7400	5 820 193 €
SHELL 4,375%14/05/18	13360	15 346 376 €
SHELL 6,375%12-38	1160	1 227 958 €
SHELL INT 4,375 20	5700	5 126 756 €
SHELL INTF 3,1% 15	2105	1 727 726 €
SHELL INTF 4% 2014	9160	7 637 998 €
SHELL INTF 5,5% 40	3400	3 308 322 €
SIAS 4,25% 10/20	1800	1 484 958 €
SIEMENS F 6,125% 26	945	900 617 €
SIEMENS FI 5,125%17	10000	11 836 407 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
SIEMENS TV140966	3400	3 495 593 €
SIMON PROP 5,65%20	3025	2 716 890 €
SIMON 5,45% 2013	7138	5 817 901 €
SKAND,ENS,TV PERP,	750	747 693 €
SKANDINAV 2,5%2015	1700	1 661 679 €
SKANDINAVISKA 5,5%14	1500	1 636 450 €
SLM CO 3,125%09-12	850	843 724 €
SLM CORP 5% 10/13	1900	1 477 976 €
SLM CORP 6,25 16	8610	6 626 053 €
SMITHS GR 4,125% 17	2000	2 090 360 €
SNAP ON 4,25% 2018	2400	1 992 232 €
SNCF 4,875 15/04/26	500000	534 339 €
SNS BANK 3625 0713	2570	2 505 975 €
SOC GEN 9,375%09-19	8	316 644 €
SOC GENERALE 5%09-19	4900000	5 582 135 €
SOC GENERALE TV2012	40	1 997 275 €
SOCGEN 3,75%08-14	354	17 840 793 €
SOCGEN 4% 2016	11900000	12 035 018 €
SOCGEN 6,125% 18	131	5 918 232 €
SODEXO 6,25%01-15	7500	8 684 835 €
SONOCO 4,375%11-2021	800	636 875 €
SOUTH POWE 4,87% 15	8590	7 391 393 €
SOUTHERN 2,375%10-15	8970	7 078 789 €
SOUTHERN 4,5% 09/40	2005	1 698 528 €
SOUTHERN 6,75%042040	5905	4 642 785 €
SOUTHERN CAL ED	2695	2 618 237 €
SOUTHW AIR 5,75% 16	2000	1 698 128 €
SOUTHWEST 6,45% 0119	4000000	3 689 968 €
SOVERG BCP 4,625 16	3000	2 271 850 €
SPANISH 3% 04/2015	8800	8 810 911 €
SPANISH GOV'T	5000	5 013 217 €
SPAREBANK3,625%03/15	2000	2 061 453 €
SPAREBK RG 3,50% 16	1900	1 935 895 €
SPECTRA EC 5,65% 20	2650	2 305 113 €
SPGB 4,6% 07-19	4000	4 067 672 €
ST CHART 3,625% 15	11825	11 985 712 €
ST GOB 6% 05-13	500	542 735 €
STAENDE 2 15/11/14	7500000	1 063 518 €
STAENDE LAN 3 21	16500000	2 492 845 €
STAENDE LAN 4 17	16400000	2 607 408 €
STAENDE LAN 4 19	35400000	5 733 208 €
STAENDE LAN 4,5 39	39900000	8 086 120 €
STAENDE LAN 5 13	28000000	4 131 701 €
STAND CHART 3,2% 16	3510	2 664 900 €
STANDARD 3,85%15	510	400 408 €
STANDARD 5,875%17	60	2 999 556 €
STANLEY 5,20%40 SR	2600	2 223 172 €
STANLN 3,875% 2016	3400	3 474 006 €
STAPLES 9,75%09-2014	7400	6 743 570 €
STATOIL 3,125% 2017	3900	3 205 475 €
STATOIL 4,375% 03/15	5000	5 603 106 €
STATSOBL 3,5 22	6400	4 311 992 €
STATSOBL 4,25 19	10000	6 900 724 €
STATSOBL 6,75 14	12000	7 960 890 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
STATSTREET 4,95% 18	3315	2 698 361 €
STE GEN 7,756% 05/13	70	2 221 710 €
STE GEN,5,25%0313	127	6 719 893 €
STE GLE 6,999%2017	20	598 060 €
STEELRIVTC 4,71 17	500	360 739 €
STGOBAIN 3,50 15	13390	13 648 030 €
STGOBAIN 4% 10/18	650	646 488 €
STGOBAIN 4,50 19	400	402 269 €
ST-GOBAIN 4,75%17	1250	1 345 477 €
STRYKER 2%11-2016	8000	6 260 092 €
SUEDE 3,5% 09-2039	6000	4 436 974 €
SUEDE 4,50%15	7800	5 014 480 €
SUEZ 4,078% 2021	300000	316 116 €
SUEZ EN 4,82%10-49	6350000	5 832 017 €
SUEZ ENV 6,25% 04/19	2850000	3 527 437 €
SUNCOR 6,85% 2039	770	738 398 €
SUNCOR ENG 5,95 34	6900	5 927 899 €
SUNCOR ENG 6,1 18	7700	7 034 756 €
SUNTRUST 3,50% 2017	7500	5 810 940 €
SUNTRUST BK 3,6% 16	14660	11 519 314 €
SVB FINANC, 5,375%20	7000	5 540 096 €
SVENSKA 3,75% 02/17	8100	8 574 419 €
SVENSKA 4,194% 12/49	500	458 099 €
SVENSKA HND 2,875%12	2580	2 018 042 €
SVK HANDBK 4,37 21	3000	3 121 784 €
SWE MATCH 3,875% 17	700	727 917 €
SWEDBANK 7,375% 2018	4000	4 201 554 €
SWEDEN 3%05-2016	14620	9 038 773 €
SWEDISH 5% 03-20	13360	9 680 407 €
SWISS 7%19/05/2014	1200	1 370 639 €
SXL 6,1% 2042	2000	1 676 992 €
TALISM ENE 6,25 38	810	745 985 €
TALISMAN 3,75%2021	6900	5 351 818 €
TARGET 6,50%37 SR	4700	4 836 865 €
T-BOND 3,5 02/39	60000	5 252 538 €
T-BOND 3,875% 40	60000	5 598 638 €
T-BOND 4,25% 11/40	60000	5 908 924 €
T-BOND 4,375 39	60000	6 018 763 €
T-BOND 4,375% 40	62000	6 220 881 €
T-BOND 4,5 08/39	128000	13 187 691 €
T-BOND 4,625 40	60000	6 305 281 €
T-BOND 4,75 02/41	60000	6 443 998 €
TCM SUB 3,55% 2015	755	619 229 €
TDC AS 3,50% 02/2015	930	988 614 €
TDCDC4,375% 2018	5300	5 793 201 €
TEACHERS INS6,85%39	773	1 529 381 €
TECK RES 10,25% 2016	4000	3 600 128 €
TECK RESOU 6 %40	4655	3 933 861 €
TEL IT 7,875% 01-14	6760	7 544 947 €
TEL,IT,5,25%13 S,B	2766	2 055 614 €
TEL,ITA,4,75%14	22	1 111 198 €
TEL,ITA,7,75%33	3095	2 943 294 €
TEL,MEXICO 5,5%15	1950	1 657 209 €
TELECOM 5,25% 2055	10	700 649 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
TELECOM 6,175%09-14	14160	10 528 535 €
TELECOM 7,721%08-38	3600	2 419 710 €
TELECOM IT 8,25%0316	8375	9 280 618 €
TELECOM ITALIA 7%17	4600	4 649 797 €
TELECOM ITL 6,75%13	4000	4 290 597 €
TELECOM ITL4,75%18	1950	1 750 322 €
TELEF 3,992% 2016	9160	6 889 140 €
TELEF SAU 3,661 17	61	2 836 845 €
TELEF SAU 7,045% 36	3929	2 953 377 €
TELEF,EM,4,375%16	2100	2 150 660 €
TELEFO 5,496%04-16	40	2 125 971 €
TELEFO MOV 2,875% 15	909	692 745 €
TELEFON,4,674%0214	75	3 927 173 €
TELEFON,5 7/8%33	400	387 708 €
TELEFONIC 3,729 0415	4750	3 562 281 €
TELEFONICA 3,406%15	40	1 984 170 €
TELEFONICA 4,6911/09	8	376 710 €
TELEFONICA 4,75% 17	20	2 049 971 €
TELEFONICA 4,967%16	50	5 053 635 €
TELEFONICA 5,431% 02	9	481 561 €
TELEFONICA 5,58%13	15	790 460 €
TELEFONICA 8,25%30	1650	1 412 527 €
TELEFONICA6,221%17	2645	2 085 791 €
TELENOR 4,125%10-20	6535	7 236 782 €
TELIASONER 3,875% 25	3150	3 214 096 €
TELSTRA 3,625%10-21	5000	5 182 389 €
TELSTRA 3,75% 2022	900	916 380 €
TELSTRA 4,25% 2020	1000	1 092 497 €
TENNET HLD 4,625% 23	200	222 598 €
TERNA 4,75% 03/21	7750	7 443 453 €
TESCO 3,375% 2018	5700	5 923 494 €
TESCO 5,125%47	500	578 494 €
TESCO 5,5 %15/11/17	480	430 457 €
TEVA 2,4% 2016	6060	4 749 365 €
TEVA PFIN 6,15 36	6375	6 100 483 €
THERMO FISH 3,2%2016	9500	7 840 195 €
THOMSON RE 4,7% 2019	425	359 801 €
THYSSEN 8% 0614	1670	1 894 491 €
TIME WAR, 6 5/8%29	1355	1 206 930 €
TIME WARN 6,75%2018	4130	3 775 385 €
TIME WARNER 6,10% 40	13910	12 948 945 €
TIME WARNER 6,55%37	12665	11 128 191 €
TIME WARNER INC	5250	4 854 904 €
TIME WARNER7,57%24	1012	1 007 621 €
TIME WARNR 3,15% 15	2840	2 309 228 €
TITIM 5,25%02-22	50	2 147 545 €
T-NOTE 0,125 13	150000	11 537 035 €
T-NOTE 0,25 10/13	150000	11 562 778 €
T-NOTE 0,375 09/12	6900	533 066 €
T-NOTE 0,5 05/13	50000	3 869 878 €
T-NOTE 0,625 07/14	153000	11 912 252 €
T-NOTE 0,625 13	10000	776 113 €
T-NOTE 1,375 13	150000	11 770 125 €
T-NOTE 1,375 18	50000	3 886 440 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
T-NOTE 1,75 04/13	50000	3 943 433 €
T-NOTE 1,75 05/16	81000	6 535 985 €
T-NOTE 1,875 14	130000	10 412 744 €
T-NOTE 1,875 17	100000	8 115 249 €
T-NOTE 2 30/04/16	90000	7 347 399 €
T-NOTE 2,125 14	100000	8 107 988 €
T-NOTE 2,125 15	80000	6 519 128 €
T-NOTE 2,25 01/15	80000	6 570 092 €
T-NOTE 2,25 07/18	77000	6 366 808 €
T-NOTE 2,375 14	140000	11 449 942 €
T-NOTE 2,375 14	150000	12 265 545 €
T-NOTE 2,375 14	140000	11 439 878 €
T-NOTE 2,375 15	80000	6 590 486 €
T-NOTE 2,375 17	120000	10 029 774 €
T-NOTE 2,625 12/14	100000	8 219 128 €
T-NOTE 2,625% 20	115000	9 565 815 €
T-NOTE 2,625% 2020	110000	9 223 719 €
T-NOTE 2,75 02/19	50000	4 258 849 €
T-NOTE 2,75 05/17	120000	10 143 849 €
T-NOTE 2,75 11/16	120000	10 118 574 €
T-NOTE 3,125 17	120000	10 400 929 €
T-NOTE 3,125 21	233700	20 171 838 €
T-NOTE 3,25 03/17	120000	10 431 594 €
T-NOTE 3,375 19	80000	7 052 718 €
T-NOTE 3,625% 21	115000	10 406 597 €
TOBACC FIN 4,50 18	1850	1 943 240 €
TOBACCO 8,375% 02/16	1700	2 142 007 €
TOTAL CAP 1,625%14	1090	860 381 €
TOTAL CAP 2,3% 2016	1405	1 118 441 €
TOTAL CAPI 3,625% 15	18439	20 095 008 €
TOYOTA 2%11-15/09/16	1500	1 177 129 €
TRANS 5,05% 15/12/16	7670	6 016 702 €
TRANS 6,375% 151221	1250	1 015 180 €
TRANSATLAN,5,75%15	4700	3 894 224 €
TRANSCANA 6,35% 2067	1500	1 161 400 €
TRANSCANAD 7,25% 38	9160	9 925 378 €
TRANS-CANADA 3,8% 20	6200	5 167 447 €
TRANSOCEA 6% 03/18	1955	1 578 723 €
TRAVEL COS 5,9% 2019	2250	2 050 503 €
TREASURY	50000	6 470 280 €
TREASURY	34000	4 742 528 €
TREASURY	38000	5 808 891 €
TREASURY 4%01-2060	3800000	5 709 745 €
TWARN CABL 5 2020	4500	3 846 977 €
TWARN CABL 5,87 40	9160	7 655 511 €
TWARN CABL 7,5% 2014	8945	7 828 253 €
TWAT UTIL 3,25% 2016	3739	3 864 865 €
TWX 5,375% 2041	2955	2 461 915 €
TXN 1,375% 5014	3500	2 739 775 €
TXN 2,375%2016	5420	4 358 681 €
TYC4,125%15/10/2014	880	727 367 €
TYCOELECT 7,125% 37	2300	2 386 416 €
UBI BANCA 4,12 13	7308	6 949 564 €
UBI SPCA 3,875% 2013	2000	1 951 462 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
UBI SPCA 4,939% 2014	2000	1 874 269 €
UBS 6%18 EMTN	14900	17 165 499 €
UBS 6,25%08-2013	800	862 779 €
UBS AG 4,75%17	1500	1 620 291 €
UBS AG LN 3,5% 2015	2395	2 477 110 €
UBS CAP 8,836% 2013	18	935 014 €
UBS JERS,TV18 EMTN	1600	1 471 717 €
UBS LONDON 5,625%14	4900	5 370 882 €
UBS PREFERED TV05	500	386 871 €
UBS STAM 2,25% 14	6365	4 812 728 €
UBS STAM 3,875% 15	4500	3 510 537 €
UBS STAM 4,875 20	9160	7 063 491 €
UBS STAM 5,875 16	3550	2 800 485 €
UBS STAM 5,875% 17	600	482 174 €
UCDP 8 7/8%151115	3156	2 713 960 €
UDR 4,25%11-2018	8000	6 131 424 €
UNCRED, TV05/2049	1800	854 413 €
UNIBAIL 3,375% 03/15	3200	3 337 830 €
UNIBAIL 3,875%10-20	500	493 171 €
UNIBAIL ROD 3,875%17	6864	6 971 965 €
UNICREDIT 1,875%2013	22970	22 956 487 €
UNICREDIT 3,625% 13	7800	7 522 944 €
UNICREDIT 4,25% 2018	530	492 747 €
UNICREDIT 4,375%20	131	1 077 086 €
UNICREDIT 4,875%13	500	512 781 €
UNICREDIT 5,75%17	5334	4 021 518 €
UNICREDIT 6,125% 21	1800	1 394 480 €
UNICREDIT 6,7%0618	2900	2 142 496 €
UNICREDIT TV15 MTN	180	1 485 490 €
UNICREDITO 5,25 14	800	817 585 €
UNICREDITO 5,25% 23	520	504 093 €
UNION BK 3% 2016	7400	5 822 318 €
UNION PAC 4,163%2022	2005	1 702 361 €
UNION PAC 4,75%2041	2542	2 117 234 €
UNION PAC 6,125 20	5200	4 930 464 €
UNIT TEC5,375%12-17	4600	4 190 163 €
UNITECH 4,875% 2015	8800	7 649 406 €
UNITECH 6,125 38	2935	2 865 759 €
UNITED UT,4,25%20	1100	1 221 881 €
UNITEDHEALT 5,7%40	101	93 116 €
UNITEDHEALTH 6,5% 37	6500	6 398 012 €
US BANK 4,95%14 SR	8100	6 843 695 €
US TREASURY 0,625%13	22000	1 706 608 €
US TREASURY 1% 2016	140000	10 911 262 €
US TREASURY1,50%16	300000	23 907 098 €
US TREASURY2,125% 21	678340	53 995 278 €
USA 0,375% 31/10/12	6350	490 460 €
USA 1% 31/08/2016	130000	10 160 402 €
USA 1,75% 10/18	50000	3 976 660 €
USA 1,75% 31/03/2014	120000	9 590 746 €
USA 3,75% 15/08/2041	389900	35 682 183 €
UTD HEALTH 6% 02/18	3000	2 781 313 €
VALEBZ6,875%11-39	4400	3 883 444 €
VALEO 4,875 05/2018	4000000	3 989 070 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
VALERO 4,5% 10-2015	5500	4 604 990 €
VALERO 6,125%10-2020	8410	7 355 098 €
VALERO EN 6,625 37	4222	3 502 180 €
VALLOUREC 4,25% 17	5000000	5 099 126 €
VALSPAR 7,25%09-2019	1000	937 341 €
VAN LAN B 4,625% 14	2000	2 081 912 €
VATTENFALL TREASURY	427	27 721 413 €
VENTAS 4,75% 2021	5860	4 400 589 €
VEOLIA 4,247% 2021	600000	625 030 €
VEOLIA ENV5,25%04-14	900000	987 721 €
VEOLIA ENVIRONNEMENT	13251000	14 224 500 €
VEOLIA4,375%17EMTN	9810000	10 674 473 €
VER COM 8,25%11-18	408	429 680 €
VERIZ WIRL 8,75% 15	3700	4 645 181 €
VERIZON 1,95 14	3860	3 050 298 €
VERIZON 3,50% 2021	18430	14 823 651 €
VERIZON 5,5 02/18	5800	5 309 382 €
VERIZON 6,40%38 SR	1560	1 536 965 €
VERIZON 7,75%30	1675	1 790 083 €
VERIZON 8,95%03-39	2189	2 733 584 €
VIACOM 4,375%09-2014	1900	1 585 138 €
VIACOM 5,625%150919	2550	2 261 748 €
VIACOM INC 3,875%21	5000	3 904 938 €
VINCI 4,125% 04/20	2400000	2 410 967 €
VINCI 4,125% 2017	2300000	2 358 899 €
VINCI 6,25%06 PERP,	2250000	2 133 540 €
VIRG ELEC 6%06-2036	2840	2 854 387 €
VIRGIN 5,25% 01/2021	2330	1 910 819 €
VIRGIN MEDI 6,5% 18	3114	2 558 485 €
VIRGINIA ELE 6,35%37	4600	4 764 438 €
VIVEND,4,50% 2013	1400000	1 467 542 €
VIVENDI 3,5 07/15	1500000	1 541 677 €
VIVENDI 4,875 %18	3000000	3 116 526 €
VIVENDI 4,875%2019	2500000	2 572 064 €
VIVFP 4,75% 2021	1300000	1 325 274 €
VODAFONE 5 1/8%15	600	686 038 €
VODAFONE 5,375%22	4000	4 829 856 €
VODAFONE 5,45%09-19	1630	1 465 523 €
VODAFONE 5,625% 17	2820	2 559 187 €
VODAFONE 5,75%16	5045	4 548 349 €
VODAFONE 6,25% 01/16	900	1 096 242 €
VODAFONE 7,875 02/30	798	907 715 €
VOITH AG 5,375%2017	1000	1 099 901 €
VOLKS IF 7 02/16	15000	18 448 588 €
VOLKS LEAS 2,25% 14	15	1 513 337 €
VOLKS LEAS 2,75% 15	50	2 574 422 €
VOLKS LEAS 3,25 %18	10	1 016 584 €
VOLKSW 6,875%2014	4150	4 826 152 €
VORNADO 5% 15/01/22	7400	5 768 489 €
VW 3,375% 2016	9	943 826 €
VZ 5,85 15/09/35	4700	4 359 873 €
WACHOVIA 4,875% 15	9160	7 528 379 €
WACHOVIA 4 3/8%16	20	1 067 338 €
WACHOVIA 4 3/8%18	33	1 524 983 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
WACHOVIA 5,5% 2013	13290	10 880 305 €
WACHOVIA 6%13 SR	16	871 063 €
WACHOVIA BK 6% 11/17	7000	6 018 515 €
WAL MART 4,875% 29	2500	2 949 639 €
WAL MART 5,25% 35	3640	3 353 941 €
WALMART 3,625% 0720	12500	10 680 868 €
WAL-MART 6,20%38	3520	3 630 235 €
WAL-MART 6,50%37	3785	4 090 515 €
WATSON 5%09-2014	410	344 267 €
WATSON 6,125% 08/19	3010	2 756 367 €
WDCAU 5,75% 09/15	6900	5 784 563 €
WEATH INTL 6,5 36	9160	7 894 132 €
WEATHER 9,625%2019	1800	1 836 196 €
WEATHERF,6,35%17	1600	1 382 630 €
WEATHERFOR 6,75 40	3500	3 088 227 €
WELLPT 6,375% 06/37	1160	1 126 344 €
WELLS 5,95%06-2036	4015	3 249 625 €
WELLS 4 1/8%16	2700	2 834 319 €
WELLS 4,75%15 SUB,	14500	11 886 626 €
WELLS 5,75% 05/2016	22085	18 608 193 €
WELLS FARGO 3,676 16	6945	5 652 081 €
WELLS FARGO 4,6%2021	3200	2 693 042 €
WESAU 3,875% 07-15	1500	1 607 003 €
WESPAC 4,25% 2016	3800	4 000 133 €
WESTERN 5,93% 10/16	4000	3 520 872 €
WESTPAC 2,25%09-2012	6600	5 130 493 €
WESTPAC 3,875%10-17	4075	4 230 989 €
WESTPAC 4,875%12	4680	4 850 648 €
WESTPAC 6,5%08-2013	42	2 310 742 €
WESTPAC B 4,625 18	2900	2 317 698 €
WESTPAC BK 4,125% 18	3500	3 666 901 €
WILL COS 7,75% 31	511	491 252 €
WILL PART 5,25% 2020	2641	2 280 178 €
WILLIA COS 8,75%32	743	762 799 €
WILLIAMS 4,125% 20	9160	7 256 979 €
WILLIAMS PAR 4% 2021	1505	1 189 419 €
WILLIS GRP 5,75% 21	3575	2 913 533 €
WILLIS NORTH 7%09-19	4600	4 051 857 €
WIRELESS 8,75% 2031	2400	2 758 476 €
WISCONSIN EN 6,25%67	1500	1 165 853 €
WPP 5,25%300115	5500	6 072 387 €
WPP FIN 8%09-2014	8200	7 273 835 €
WPP FINANC 4,75% 21	1535	1 169 002 €
WPP GP 4,375%13	750	775 797 €
WPP GROUP PLC	5650	6 532 584 €
WPS RES 6,11%2066	1500	1 116 277 €
WYETH 5,45% 07-2017	2845	2 596 504 €
WYETH 5,95 04/37	2470	2 448 597 €
WYETH TF6,5% 03/2034	475	495 861 €
XCEL ENERGY 4,8%41	2000	1 621 615 €
XEROX 4,25%15 SR	11800	9 766 584 €
XEROX 4,5% 2021	2930	2 299 278 €
XEROX 6,4%0316	3095	5 452 644 €
XEROX 8,25%09-2014	4000	3 501 060 €

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
XL CAPITAL 5,25%14	2200	1 811 019 €
XL GROUP 5,75%2021	2805	2 306 819 €
XPRSS SCRP 6,25% 14	4580	3 852 071 €
XSTRTA CDA 4,95 %21	1160	923 682 €
XSTRTA CDA 5,25 17	1000	1 096 166 €
XSTRTA CDA 6 % 41	830	659 895 €
XTO ENERGY 5,5 %18	2500	2 347 621 €
YUM 6,875% 15/11/37	1000	976 728 €
YUM BRANDS 3,87% 20	10980	8 681 840 €
YUM BRANDS 4,25%2015	800	669 812 €
YUM BRANDS 6,25% 18	5900	5 372 234 €
ZFS FIN,6,45%65	1565	1 101 135 €
ZURICH 7,50%09-2039	44	2 278 158 €
ZURICH F,6,5%10-15	5100	5 807 742 €
ZURICH FIN,4,5%14	59	3 127 329 €

SHORT TERM NOTES

Total (€)	2 845 694 835 €
------------------	------------------------

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
CR01 1,4% 20/01/11	30000000	29 998 320 €
CR03 3,75% 07/01/08	18000000	19 284 939 €
CR03 4,50% 12/07/08	7000000	7 562 143 €
CR03 2,50% 12/01/09	11500000	12 133 170 €
CR03 3,00% 23/06/09	6700000	7 096 766 €
CR03 2,50% 26/01/10	11500000	12 145 970 €
CR03 0,45% 14/01/11	135634151	135 309 277 €
CR01 1,341% 07/07/11	30000000	29 978 833 €
CR03 2,50% 25/07/10	13800000	14 289 833 €
CR01 0,225% 01/12/11	30000000	29 995 401 €
CR07 1,38% 29/11/11	100000000	99 988 092 €
CR07 1,10% 14/12/11	200000000	199 911 231 €
CR07 1,38% 29/11/11	100000000	99 988 092 €
CR07 1,26% 14/12/11	150000000	149 946 849 €
CR01 0,219% 15/12/11	30000000	29 986 440 €
CR01 0,285% 13/12/11	30000000	29 960 864 €
CR07 1,38% 29/11/11	300000000	299 955 323 €
CR07 1,38% 29/11/11	250000000	249 962 769 €
CR07 1,38% 29/11/11	100000000	99 988 092 €
CR07 1,13% 14/12/11	200000000	199 929 132 €
CR07 0,84% 14/12/11	250000000	249 911 415 €
CR07 1,38% 29/11/11	400000000	399 940 431 €
CR07 1,47% 29/11/11	250000000	249 970 230 €
CR07 1,26% 14/12/11	150000000	149 946 849 €
CR16 0,01% 18/08/11	50000000	38 514 375 €

MUTUAL FUNDS

Total (€)	4 422 608 272 €
------------------	------------------------

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
AMUNDI ACT,EMERG,I2	12	60 685 529 €
DIMENSIONAL EMERG	7 808 131	117 434 293 €
BLACKROCK FONDS INDI	9 814 827	127 730 158 €
CAPITAL INTL	1 198 588	85 063 805 €
SCHRODERS INTL EMERG	11 090 586	118 447 453 €
VANGUARD EMERG MK	918 384	99 537 221 €
COMGEST EMERG 3DEC	6 235 000	132 701 471 €
CIP EM,TOT,OPP A7C	7 299 270	62 700 730 €
BNPIECM (EUR)	2 468 057	300 233 231 €
BNY MELLON GL-EMM	272 140 216	337 649 242 €
STONE HARBOR-EM MKLC	2 904 467	307 136 964 €
BAER LOC,EM,C 3DEC	1 308 869	306 599 078 €
HSBC GIF GL	5 378 060	125 540 538 €
FRANK TEMP INV EMKT	20 847 285	330 325 561 €
PICTET FUNDS LUX -EM	599 115	141 711 848 €
PICTET FUND LUX	1 008 569	146 592 933 €
ING RENTA EMERG MARK	3 137 158	141 488 664 €
AVIVA I EMERG, MARKT	91 402	73 752 437 €
BFT MONET,SI,3DEC	29 947	400 208 713 €
BNP CASH INVEST I	3 526	200 084 280 €
LBPAM TRES,I 5DEC	74 337	806 984 124 €

PRIVATE EQUITY

Total (€)	563 129 186 €
------------------	----------------------

Secuty name	Quantity	Stock price (€)
ACCESS CAPITAL PA	1	118 684 572 €
ANTIN INFRASTRUCT, A	495 000	25 040 663 €
ANTIN INFRASTUCT, B	500 000	500 000 €
AXA SEC, FUND IV LP	1	119 216 137 €
LEHMAN BROTHERS INTE	1	159 319 122 €
PANTHEON FRR EUROPE	1	140 368 692 €