



**COMPOSITION DU PORTEFEUILLE DU FRR
AU 31 DECEMBRE 2016**

ENCOURS TOTAUX SOUS GESTION	34 469 516 089 €
------------------------------------	-------------------------

ACTIONS	
Encours sous gestion dans la poche	10 037 299 808 €

Libellé des valeurs	Quantité de titres	Valeur des titres au 31/12/2016	Ratio d'emprise
NSK LTD	282400	3 108 170 €	0,051
21ST CENTURY SHS A	70105	1 863 706 €	0,007
3I GROUP	103725	855 464 €	0,011
4IMPRINT GROUP	243355	5 060 393 €	0,866
AAC TECHNO HOLD NV	111023	956 457 €	0,009
AAREAL BANK	32491	1 162 041 €	0,054
AARHUSKARLSHAMN AB	30000	1 876 957 €	0,071
ABB LTD NOM	209081	4 189 422 €	0,009
ABBOTT LABO	280651	10 220 246 €	0,019
ABBVIE	52622	3 124 143 €	0,003
ABC-MART	30600	1 646 648 €	0,037
ABERDEEN ASSET	87847	264 797 €	0,007
ABERTIS INFRAES,A	576946	7 670 497 €	0,058
ABLYNX	150695	1 629 766 €	0,247
ABN AMRO GROUP	500036	10 525 758 €	0,053
ACADIA HEALTHCARE	193290	6 065 797 €	0,221
ACCENTURE PLC-CL	75321	8 364 398 €	0,012
ACCESSO TECHNOLOGY	118002	2 073 606 €	0,530
ACCIONA	137246	9 597 613 €	0,240
ACCOR	124771	4 420 637 €	0,044
ACCSYS TECHNOLOGIE	731569	570 624 €	0,807
ACE NOM	54120	6 779 175 €	0,012
ACERINOX	285308	3 596 307 €	0,103
ACKERMANS HAAREN	39945	5 276 735 €	0,119
ACS ACT,CONSTR	95422	2 864 568 €	0,030
ACTELION	9435	1 940 688 €	0,009
ACTIVISION	189331	6 481 861 €	0,025
ACUITY BRANDS	22550	4 935 665 €	0,051
ADDTECH B	185391	2 757 067 €	0,285
ADECCO NOM	40539	2 520 452 €	0,024
ADIDAS NOM	221322	33 231 498 €	0,106
ADIENT PLC	99391	5 521 984 €	0,106
ADMIRAL GROUP	13782	294 983 €	0,005
ADOBE SYSTEMS	121620	11 870 850 €	0,024
ADOCIA	27712	1 690 432 €	0,405
ADP (PROMESSE)	107565	10 950 117 €	0,109
ADVAN	13700	134 081 €	0,025
ADVANCE AUTO PARTS	91417	14 657 922 €	0,124
ADVANSIX INC	208	4 366 €	0,001
AECOM TECHNOLOGY	11346	391 126 €	0,007
AED OIL LTD	34369	- €	0,000
AEGON	4974252	26 005 389 €	0,240
AENA	149047	19 323 944 €	0,099
AERCAP HOLDINGS NV	303017	11 954 053 €	0,164
AES	190650	2 100 358 €	0,029
AETNA	59707	7 019 924 €	0,017
AF AB-B	108000	1 882 279 €	0,143

AFFILIATED MANAGER	2417	332 961 €	0,004
AFLAC	27851	1 837 810 €	0,007
AFRICA OIL	2160499	4 094 621 €	0,473
AGCO	5100	279 769 €	0,006
AGEAS	636314	23 931 770 €	0,294
AGILENT TECHN	14796	639 114 €	0,005
AGNICO EAGLE MINES	32960	1 315 417 €	0,015
AGRIUM	6411	611 707 €	0,005
AIA GROUP LTD	1673578	8 953 555 €	0,014
AIDA ENGINEERING	75000	676 105 €	0,102
AIR FRANCE	129083	667 875 €	0,043
AIR LEASE	8900	289 677 €	0,009
AIR LIQUIDE	267353	28 245 844 €	0,069
AISIN SEIKI	130700	5 386 479 €	0,044
AKAMAI TECHN	13474	851 810 €	0,008
AKKA TECHNOLOGIES	139706	4 838 019 €	0,689
AKZO NOBEL	236473	14 044 131 €	0,094
ALASKA AIR GROUP	99155	8 341 335 €	0,080
ALBEMARLE	6870	560 673 €	0,006
ALEXANDRIA REAL	4236	446 311 €	0,005
ALEXION PHARMA, INC	80531	9 341 520 €	0,037
ALFA LAVAL	55806	878 266 €	0,013
ALIBABA SPON,ADR	113662	9 462 584 €	0,005
ALIGN TECHNOLOGY	2098	191 212 €	0,003
ALIM,COUCHE SUB	34580	1 488 374 €	0,008
ALKERMES PLC	8738	460 448 €	0,006
ALL NIPPON AIRWAYS	375000	959 594 €	0,011
ALLEGHANY	1578	909 802 €	0,010
ALLEGION	8274	502 049 €	0,009
ALLERGAN PLC	34054	6 780 451 €	0,010
ALLIANCE DATA SYS	3447	746 755 €	0,006
ALLIANZ	252258	39 604 506 €	0,055
ALLIED WLD ASS HLD	1649	83 970 €	0,002
ALLSTATE	276834	19 453 838 €	0,075
ALLY FINANCIAL	154052	2 777 975 €	0,033
ALPES (COMPAGNIE)	13924	263 164 €	0,057
ALPHABET CL,A	57724	43 368 935 €	0,009
ALPHABET CL,C	51441	37 642 278 €	0,008
ALS LTD	95076	394 246 €	0,019
ALSTOM REGROUPT	1201353	31 445 415 €	0,547
ALTAGAS	11556	276 962 €	0,007
ALTEN	221704	14 792 091 €	0,658
ALTICE CL,A	313960	5 911 867 €	0,026
ALTICE CL,B	13031	246 677 €	0,001
ALTRAN TECHN,	1319005	18 307 789 €	0,750
ALTRIA GROUP	276992	17 757 951 €	0,014
AMADEUS IT HOLDING	330463	14 266 088 €	0,075
AMAZON COM	106825	75 946 777 €	0,022
AMCOR	551066	5 655 936 €	0,048
AMDOCS	23102	1 275 839 €	0,016
AMER GROUP S,A	284579	7 194 157 €	0,240
AMER,FCIAL GRP INC	1401	117 048 €	0,002
AMERI TOWER NV	31511	3 157 224 €	0,007
AMERICAN AIRLINES	218520	9 673 097 €	0,042
AMERICAN CAPITAL	69311	1 191 380 €	0,021
AMERICAN EXPRESS	212648	14 935 258 €	0,023
AMERICAN INTL GRP	58507	3 622 747 €	0,006
AMERICAN WATER WKS	193892	13 301 754 €	0,109
AMERIPRISE FCIAL	89721	9 436 973 €	0,057
AMERISOURCEBERGEN	29417	2 180 721 €	0,014
AMERISUR RESOURCES	5784449	1 812 723 €	0,478
AMETEK INC	23278	1 072 587 €	0,010
AMGEN	22443	3 111 060 €	0,003
AMP	637340	2 205 268 €	0,022
AMPHENOL CL,A	18479	1 177 330 €	0,006
AMUNDI	56637	2 816 275 €	0,034

ANADARKO PETROLE	6142	406 050 €	0,001
ANALOG DEVICES	23544	1 621 015 €	0,008
ANDRITZ AG	121325	5 786 596 €	0,117
ANGLO IRISH BANK	1655585	- €	0,000
ANHEUSER-BUSCH INB	102100	10 206 612 €	0,005
ANIMA HOLDING	567195	2 926 726 €	0,189
ANNALY CAP,MGMT	152289	1 439 508 €	0,015
ANSELL	79828	1 354 215 €	0,054
ANSYS	8385	735 272 €	0,010
ANTOFAGASTA	149886	1 185 251 €	0,015
AOI ELECTRONICS	87500	2 158 680 €	0,729
AON PLC	18552	1 961 701 €	0,007
AOZORA BANK	300000	1 007 147 €	0,025
APA GROUP ST,SECU	509700	2 998 853 €	0,046
APACHE	17166	1 032 971 €	0,005
APPLE	388453	42 655 251 €	0,007
APPLEGREEN	602190	2 529 198 €	0,748
APPLIED MATERIALS	191597	5 861 896 €	0,018
APPLUS SERVICES	563213	5 435 005 €	0,433
APTARGROUP	11763	819 144 €	0,019
AQUA AMERICA INC	105835	3 014 253 €	0,060
ARAMARK	11563	391 591 €	0,005
ARCELORMITTAL	355014	2 490 778 €	0,012
ARCH CAPITAL GROUP	18283	1 495 748 €	0,015
ARCHER DANIELS	8193	354 596 €	0,001
ARCONIC	23721	416 959 €	0,005
ARISTOCRAT LEISURE	181455	1 930 902 €	0,028
ARKEMA	241068	22 404 860 €	0,319
AROUNDTOWN PROP	940581	4 016 281 €	0,139
ARROW ELECTRON,ORD	6301	425 941 €	0,007
ASAHI GLASS	275000	1 779 374 €	0,023
ASAHI INTEC	42400	1 631 952 €	0,066
ASAHI KASEI	972000	8 055 174 €	0,069
ASCENDAS REAL EST	897003	1 336 263 €	0,031
ASCENTIAL PLC	1789254	5 657 447 €	0,447
ASCOM HOLDING	333557	4 978 463 €	0,927
ASHLAND GLOBAL HLD	10917	1 131 186 €	0,018
ASHTAD GROUP	683241	12 646 682 €	0,137
ASM INTERNATIONAL	81085	3 457 059 €	0,127
ASM PACIFIC TECHN	124352	1 249 200 €	0,030
ASML HOLDING	112197	11 965 810 €	0,013
ASML HOLDING	55800	5 935 776 €	0,006
ASOS PLC	51231	2 979 272 €	0,061
ASPEN INSURANCE	1685	87 864 €	0,003
ASSICURAZ,GEN,ORD	964662	13 621 027 €	0,062
ASSOCIATED BANC	4126	96 622 €	0,003
ASSURANT	12926	1 138 003 €	0,023
ASSYSTEM	130311	3 449 332 €	0,587
ASTRAZENECA	116665	6 064 913 €	0,009
ASX	44447	1 517 777 €	0,023
AT AND T	897000	36 169 149 €	0,015
AT-GROUP	43000	882 924 €	0,122
ATLANTIA	273844	6 095 767 €	0,033
ATLAS COPCO AB	66705	1 931 814 €	0,005
ATLAS COPCO S,B	41958	1 088 578 €	0,003
ATMOS ENERGY	50181	3 527 775 €	0,048
ATOS ORIGIN	311018	31 179 555 €	0,297
AUCKLAND INTL ARPT	478242	1 976 011 €	0,040
AURELIUS	164325	9 139 757 €	0,527
AURIZON HLDGS LTD	67877	235 328 €	0,003
AUS,NZL BKG GROUP	533586	11 143 544 €	0,018
AUSNET SERVICES	777078	842 910 €	0,022
AUSTRALIAN GAS	72137	1 093 990 €	0,011
AUTO TRADER GR	1081990	5 184 324 €	0,110
AUTODESK INC	11467	804 620 €	0,005
AUTOGRILL	110000	944 350 €	0,043

AUTOLIV	8527	914 748 €	0,005
AUTOLIV SWED,DEPOS	44752	4 801 196 €	0,025
AUTOM,DATA PROCES	20213	1 969 654 €	0,004
AUTONATION	10145	467 935 €	0,010
AUTOZONE	3289	2 462 782 €	0,011
AVACTA	607429	512 358 €	0,888
AVALONBAY COMMUN	14150	2 376 556 €	0,010
AVANZA HOLDING BK	279816	10 775 632 €	0,938
AVERY DENNISON	12100	805 558 €	0,014
AVEVA GROUP PLC	218650	4 813 066 €	0,342
AVIS BUDGET GROUP	8982	312 358 €	0,010
AVIVA	395622	2 254 341 €	0,010
AVNET	19655	887 200 €	0,015
AXA	3303473	79 233 800 €	0,136
AXALTA COATING SYS	19783	510 166 €	0,008
AXEL SPRINGER	97548	4 499 889 €	0,090
AXIS CAPITAL	26812	1 659 179 €	0,030
AXWAY SOFTWARE	26982	825 649 €	0,130
BABCOCK INTL GRP	49587	553 613 €	0,010
BAE SYSTEMS	324849	2 251 033 €	0,010
BAKER HUGHES ORD	35495	2 186 405 €	0,008
BAKKAFROST	40000	1 510 298 €	0,082
BALL	8106	576 930 €	0,005
BALOISE HOLDING	16251	1 944 966 €	0,033
BANCA GENERALI	214050	4 850 373 €	0,184
BANCA POP,EMILIA	483537	2 446 697 €	0,100
BANCO BILBAO VIZC	3037870	19 484 898 €	0,046
BANCO POP,ESPANOL	4007350	3 678 747 €	0,095
BANCO POPOLARE NV	797113	1 826 983 €	0,030
BANCO SABADELL	2993656	3 960 607 €	0,053
BANDO CHEM,IND	95000	800 800 €	0,201
BANK AMERICA	1991707	41 731 903 €	0,020
BANK IRELAND	22756498	5 325 021 €	0,070
BANK N,Y, MELLON	59759	2 684 410 €	0,006
BANK NOVA SCOTIA	62232	3 289 239 €	0,005
BANK OF EAST ASIA	291706	1 059 433 €	0,011
BANK OF HAWAII CORP	454	38 175 €	0,001
BANK OF MONTREAL	40513	2 765 980 €	0,006
BANK QUEENSLAND	107243	873 935 €	0,028
BANKIA	5046553	4 900 203 €	0,044
BANKINTER	909498	6 693 905 €	0,101
BANKUNITED	2026	72 396 €	0,002
BARCLAYS	1583667	4 145 623 €	0,009
BARD (C,R,)	7624	1 623 899 €	0,010
BARRATT DEV	118064	639 559 €	0,012
BARRICK GOLD	263585	4 000 640 €	0,023
BARRY CALLEBAUT N	677	786 886 €	0,012
BASF SE	378459	33 421 714 €	0,041
BASIC-FIT	376632	6 037 411 €	0,689
BASWARE	116252	4 219 948 €	0,807
BAXTER INTL	41947	1 763 385 €	0,008
BAYER	120349	11 930 196 €	0,015
BAYER,MOTO,PRIV	25435	1 849 125 €	0,004
BB AND T	414672	18 485 781 €	0,051
BBA AVIATION	1651582	5 481 410 €	0,160
BCA MEDIOLANUM	203627	1 390 772 €	0,028
BCA MILANO ORD	3680857	1 318 851 €	0,000
BCA MPS GROUP AOR	59770	901 332 €	0,002
BCE	64409	2 642 479 €	0,007
BCO ESPIRITO SANTO	3323765	- €	0,059
BCO SANT,CENT,HISP	9962062	49 401 865 €	0,068
BCP BCO COMERCIAL	625097	669 479 €	0,001
BE AEROSPACE	10167	580 187 €	0,010
BE SEMICONDUCTOR	67118	2 123 614 €	0,168
BECTON DICKINSON	40624	6 376 206 €	0,019
BED BATH BEYOND	26127	1 006 685 €	0,017

BEIERSDORF NOM	126391	10 187 115 €	0,050
BELC	59300	2 176 376 €	0,284
BELGACOM	338699	9 266 805 €	0,100
BELIMO HOLDING	4232	12 151 209 €	0,688
BELVEDERE	253000	4 518 580 €	0,893
BEMIS CO	11831	536 391 €	0,013
BEND,AND ADEL,BANK	139089	1 213 663 €	0,029
BENETEAU	321200	4 416 500 €	0,390
BERENDSEN PLC	223877	2 283 094 €	0,130
BERKELEY UNIT	13948	458 833 €	0,010
BERKLEY	19523	1 231 073 €	0,016
BERKSHIRE HATHAW,A	4	925 797 €	0,001
BERKSHIRE HATHAWAY B	63917	9 876 457 €	0,005
BERTRANDT	40000	3 867 200 €	0,394
BEST BUY	51022	2 064 099 €	0,016
BGP HOLDINGS	3056274	- €	0,000
BHP BILLITON	222210	3 823 001 €	0,007
BIC	180484	23 309 509 €	0,377
BIG LOTS INC	2329	110 869 €	0,005
BIG YELLOW	500000	4 015 347 €	0,317
BILFINGER BERGER	35240	1 288 903 €	0,077
BIOGEN IDEC	25849	6 949 760 €	0,012
BIOMARIN PHARM	58060	4 560 029 €	0,034
BIOMERIEUX	146564	20 797 432 €	0,371
BLACKBERRY	56775	370 887 €	0,011
BLACKROCK	5194	1 873 927 €	0,003
BLOCK (H,AND R,)	45574	993 360 €	0,022
BMW	181687	16 124 721 €	0,028
BNP PARIBAS	1296754	78 518 455 €	0,104
BOC AVIATION LTD	193600	901 990 €	0,028
BOC HKG HOLD	674995	2 290 525 €	0,006
BOEING	128477	18 963 071 €	0,021
BOIRON	48460	4 078 878 €	0,249
BOLIDEN	66370	1 647 821 €	0,024
BOLLORE INVEST	4025918	13 486 825 €	0,139
BOLLORE NV 17	13541	44 279 €	0,000
BOLSAS MERCADOS	75000	2 099 625 €	0,090
BOMBARDIER CV CL,B	207370	316 674 €	0,009
BONDUELLE	166784	4 171 268 €	0,521
BOOKER GRP PLC	4065986	8 359 660 €	0,229
BORAL (NEW)	730825	2 714 378 €	0,062
BORG WARNER	77534	2 899 209 €	0,036
BOSHIWA INTL	122000	- €	0,006
BOSSARD HOLDING AG	22598	3 022 904 €	0,340
BOSTON PROPERTIES	12050	1 436 975 €	0,008
BOSTON SCIENTIFIC	329547	6 758 096 €	0,024
BOUYGUES	302741	10 306 817 €	0,087
BP PLC SPONSORED	430148	15 244 306 €	0,002
BPOST - PROMESSES	207682	4 672 845 €	0,104
BRAAS MONIER	72432	1 823 476 €	0,168
BRAMBLES	417209	3 551 690 €	0,026
BREMBO	251696	14 472 520 €	0,377
BRENNTAG	227673	12 021 134 €	0,147
BRIDGESTONE	55800	1 911 394 €	0,007
BRINKER INTL	2599	122 046 €	0,005
BRISTOL MYERS ORD	134910	7 474 890 €	0,008
BRIT,AMER,TOBACCO	178295	9 653 120 €	0,010
BRITISH SKY BROAD	118438	1 375 024 €	0,007
BRIXMOR PROPERTY	2821	65 313 €	0,001
BROADCOM	65832	11 033 062 €	0,017
BROADRIDGE FINL	17432	1 095 749 €	0,015
BROCADE COMM SYST	70348	833 038 €	0,017
BROOKFIELD ASSET	39445	1 235 401 €	0,004
BROTHER INDUSTRIES	315100	5 401 899 €	0,114
BROWN AND BROWN	11902	506 209 €	0,008
BROWN FORMAN CL,B	48626	2 070 898 €	0,016

BT GROUP	806615	3 467 046 €	0,008
BUNGE	16445	1 126 321 €	0,012
BUNZL	42307	1 045 284 €	0,013
BURBERRY GROUP	125567	2 202 130 €	0,029
BURCKHARDT COMPRES	8859	2 212 684 €	0,261
BUREAU VERITAS	1407117	25 905 024 €	0,318
BURFORD CAPITAL	465985	3 125 309 €	0,224
BURLINGTON STORES	19750	1 586 928 €	0,028
C, UYEMURA & CO	93900	3 892 756 €	0,951
CA	31847	959 260 €	0,008
CABOT OIL GAS	29696	657 690 €	0,006
CACI INTL CL,A	831	97 932 €	0,003
CADENCE DESIGN SYS	12760	305 103 €	0,004
CAE	25649	340 548 €	0,010
CAFE DE CORAL HOLD	338137	1 039 925 €	0,058
CAIRN ENERGY	658401	1 819 550 €	0,114
CAIRN HOMES LTD	1434218	1 936 194 €	0,208
CALTEX AUSTRALIA	147066	3 075 402 €	0,056
CAMBIAN GROUP	1493595	2 165 328 €	0,811
CAMDEN PROPERTY PB	5046	402 197 €	0,006
CAMECO	106180	1 053 955 €	0,027
CAMPBELL SOUP	25630	1 469 397 €	0,008
CAN,NAT,RAILWAY	5118	326 956 €	0,001
CANADIAN IMBK COMM	27368	2 119 861 €	0,007
CANADIAN NATU,RES	78934	2 385 794 €	0,007
CANADIAN PACIFIC	1546	209 376 €	0,001
CANADIAN TIRE CL,A	9853	970 149 €	0,015
CANADIAN UTILITIES	7463	190 948 €	0,004
CANCOM SE	115358	5 192 840 €	0,705
CAP GEMINI	408132	32 711 780 €	0,238
CAPITA GROUP	78470	488 139 €	0,012
CAPITACOMM,REIT	712033	691 566 €	0,000
CAPITAL ONE FCIAL	66691	5 516 116 €	0,014
CAPITAMALL TRST FD	1003452	1 241 309 €	0,000
CAPITOL FEDL FINL	3065	47 831 €	0,002
CARD FACTORY	610743	1 810 192 €	0,179
CARDINAL HEALTH	178459	12 177 003 €	0,056
CARE CAPITAL PROPERT	9081	215 241 €	0,011
CARGOTEC B	94699	4 061 640 €	0,172
CARL ZEISS MEDITEC	60000	2 100 000 €	0,074
CARMAX	11394	695 577 €	0,006
CARPHONE WAREHOUSE	118342	491 613 €	0,010
CARREFOUR	892862	20 437 611 €	0,118
CASINO GUICHARD	280284	12 778 148 €	0,253
CASY US	386	43 506 €	0,001
CATERPILLAR	32495	2 857 157 €	0,006
CBRE GP A	24098	719 456 €	0,007
CBS CL,B	53386	3 220 116 €	0,012
CCL IND,CL,B N,VTG	951	177 365 €	0,003
CDK GLOBAL	11334	641 409 €	0,008
CDW CORP (NEW)	6247	308 515 €	0,004
CELANESE SER,A	83310	6 219 322 €	0,058
CELESTICA SUB,VTG	4191	47 141 €	0,003
CELGENE	126987	13 935 762 €	0,016
CELLECTIS	52571	852 176 €	0,149
CELLNEX TELECOM	372612	5 091 743 €	0,161
CENTENE	63099	3 380 635 €	0,037
CENTERPOINT ENERGY	79441	1 855 820 €	0,018
CENTRAL JAP,RAILW	32600	5 095 870 €	0,016
CENTRICA	601858	1 650 597 €	0,011
CENTURY LEAS, SYS	198500	6 454 193 €	0,186
CENTURYTEL	36700	827 425 €	0,007
CERNER	23306	1 046 698 €	0,007
CERV INFO SOL	970822	7 659 786 €	0,498
CFG LTD	223873	- €	0,006
CGG	28050	384 566 €	0,127

CH ROBINSON WORLD	34529	2 398 288 €	0,024
CHALLENGER FCIAL	174946	1 349 988 €	0,031
CHAMPION REIT	1786318	917 444 €	0,031
CHARGEURS	140000	2 234 400 €	1,035
CHARTER CIONS CL A	10355	2 826 652 €	0,004
CHECK POINT SOFTW	13832	1 107 609 €	0,008
CHEMTURA	9694	305 135 €	0,015
CHENIERE ENERGY	11261	442 326 €	0,005
CHESAPEAKE ENERGY	17824	118 630 €	0,002
CHEUNG KONG	170227	1 284 355 €	0,006
CHEVRONTXACO	277334	30 947 819 €	0,015
CHIBA BANK	130000	757 677 €	0,015
CHICAG BDG&IRON CO	5239	157 704 €	0,005
CHIMERA INVESTMENT	6487	104 678 €	0,003
CHINA HIGH PRECIS,	152000	- €	0,015
CHINA MENGNIU	594437	1 085 995 €	0,015
CHINA METAL RECYCLIN	89400	- €	0,000
CHINA MILK PROD TP	239000	- €	0,000
CHINA OCEANWIDE HLDG	5115087	481 632 €	0,032
CHIPOTLE MEXICAN A	3830	1 370 121 €	0,013
CHNA ANIM HLTH CRE	167770	- €	0,009
CHOW TAI FOOK JEWL	1698220	1 231 459 €	0,017
CHR, HANSEN HOLD	178866	9 408 113 €	0,136
CHRISTIAN DIOR	82797	16 497 302 €	0,046
CHUDENKO	30000	629 406 €	0,046
CHUO MITSUI TRUST	129700	4 410 109 €	0,033
CHURCH AND DWIGHT	29942	1 254 456 €	0,012
CI FINANCIAL	31099	634 754 €	0,011
CIE AUTOMOTIVE	203309	3 764 266 €	0,158
CIE FIN RICHEMONT	52231	3 286 363 €	0,010
CIGNA	154544	19 544 560 €	0,060
CIMAREX ENERGY	7200	927 689 €	0,008
CIMIC GROUP LTD	9921	237 979 €	0,003
CINCINNATI FCIAL	11747	843 646 €	0,007
CINEMARK HOLDINGS	370	13 456 €	0,000
CINEWORLD GROUP	400000	2 647 610 €	0,149
CINTAS	13322	1 459 578 €	0,013
CISCO SYSTEMS	541328	15 509 772 €	0,011
CIT GROUP	16388	663 133 €	0,008
CITIGROUP	392737	22 128 808 €	0,014
CITIZENS FINL GRP	97246	3 285 020 €	0,019
CITRIX SYSTEMS	10745	909 823 €	0,007
CITY DEVELOPMENTS	281523	1 529 735 €	0,031
CK HUTCHISON	432335	4 647 086 €	0,011
CK PROPERTY HOLDINGS	515339	2 996 505 €	0,013
CKD	60000	647 208 €	0,087
CLARIANT NOM	152989	2 507 478 €	0,046
CLARKSON	100000	2 545 689 €	0,331
CLEAN HARBORS	20700	1 092 159 €	0,036
CLOETTA	817927	2 449 854 €	0,293
CLOROX	18253	2 077 009 €	0,014
CLOSE BROTHERS GRP	152264	2 577 571 €	0,101
CLP HOLDINGS	126263	1 100 101 €	0,005
CME GROUP	58512	6 399 013 €	0,017
CMS ENERGY ORD	9200	363 028 €	0,003
CNA FINANCIAL	6523	256 653 €	0,002
CNA HONGXING SPRT	449000	- €	0,016
CNH INDUSTRIAL NV	1053101	8 703 880 €	0,077
CNO FCIAL GRP INC	1314	23 857 €	0,001
CNP ASSURANCES	656360	11 551 936 €	0,096
COACH	23774	789 349 €	0,008
COBHAM	249429	478 345 €	0,015
COCA COLA EUR	102650	3 064 898 €	0,021
COCA-COLA	646419	25 409 369 €	0,015
COCA-COLA AMATIL	369679	2 568 414 €	0,048
COCHLEAR	28959	2 436 445 €	0,050

COCOKARA FINE INC	17500	610 974 €	0,069
COGNIZANT TECHN,A	57937	3 077 706 €	0,010
COLGATE PALMOLIVE	74304	4 610 053 €	0,008
COLOPLAST B NV	13485	863 810 €	0,007
COLRUYT	321990	15 135 140 €	0,215
COLUMBIA PROPERTY	2208	45 217 €	0,002
COM HEM HOLDING	536700	4 867 379 €	0,284
COMCAST CL,A	452161	29 601 059 €	0,019
COMERICA	12445	803 630 €	0,007
COMFORTDELGRO	431408	699 290 €	0,020
COMINAR REAL ESTATE	9613	100 041 €	0,005
COMM,BANCSHARES	13192	723 043 €	0,013
COMMERZBANK NV	1230097	8 913 283 €	0,098
COMPASS GROUP	153628	2 701 448 €	0,009
COMPUGROUP MEDICAL	105338	4 102 388 €	0,198
COMPUTER SCIENCES	77694	4 376 940 €	0,055
COMPUTERSHARE	226270	1 935 551 €	0,041
COMSYS HOLDINGS	40000	696 142 €	0,028
COMW,BK AUSTRALIA	277617	15 706 726 €	0,016
CONAGRA FOODS	17727	664 710 €	0,004
CONCHO RESOURCES	152335	19 151 098 €	0,104
CONCORDIA FIN GRP	185000	846 044 €	0,014
CONOCOPHILLIPS	542137	25 771 746 €	0,044
CONSOL,EDISON	84534	5 905 158 €	0,028
CONSORT MEDICAL	566529	7 035 154 €	1,151
CONSTELLAT SFTWRE	1759	758 741 €	0,008
CONSTELLATION CL,A	62549	9 091 621 €	0,035
CONTACT ENERGY	269307	829 650 €	0,038
CONTINENTAL	23563	4 328 523 €	0,012
CONTINENTAL RES	13285	649 167 €	0,004
COOPER NV	2703	448 292 €	0,006
CORE LABORATORIES	13089	1 489 645 €	0,030
CORECIVIC IN	5692	131 999 €	0,005
CORNING	17272	397 432 €	0,002
CORP,FINANC,ALBA	41173	1 764 263 €	0,071
COSMOS PHARMA	2500	437 934 €	0,012
COSTAR GROUP	11616	2 075 847 €	0,036
COSTCO WHOLESALE	57121	8 670 911 €	0,013
COTY CL A	14178	246 124 €	0,002
COVESTRO AG	175137	11 406 673 €	0,173
CRANE	415	28 376 €	0,001
CRANEWARE	133414	2 070 918 €	0,495
CREATE SD HOLDINGS	119900	2 439 504 €	0,179
CREDIT AGRICOLE	1664483	19 607 610 €	0,058
CREDIT SAISON	65000	1 097 416 €	0,035
CREDIT SUISSE GRP	196202	2 673 984 €	0,009
CREST NICHOLSON HG	390174	2 070 628 €	0,153
CRH	85970	2 833 141 €	0,010
CRH PLC	38390	1 251 337 €	0,005
CRITERIA CAIXACORP	3217993	10 104 498 €	0,054
CRODA INTERNATIO PLC	21766	814 950 €	0,017
CROWN	132557	1 053 831 €	0,018
CROWN CASTLE INTER	219103	18 024 714 €	0,061
CROWN HOLDINGS	7960	396 736 €	0,006
CSL	82446	5 683 374 €	0,018
CSR	193264	612 989 €	0,038
CSRA INC	8102	244 577 €	0,005
CST BRANDS INC	4185	191 048 €	0,006
CSX	5649	192 433 €	0,001
CTS EVENTIM	546378	16 364 021 €	0,569
CULLEN FROST BKERS	739	61 817 €	0,001
CUMMINS	13348	1 729 577 €	0,008
CURTISS WRIGHT CORP	2561	238 824 €	0,006
CVS CAREMARK	69550	5 203 309 €	0,007
CVS GROUP	150459	1 944 193 €	0,237
CYBERAGENT	27100	636 192 €	0,021

CYBERDYNE INC	73300	984 318 €	0,053
D R HORTON	41266	1 069 258 €	0,011
D, CARNEGIE & CO	160784	1 828 998 €	0,224
DAH SING BANKING	140261	244 584 €	0,010
DAH SING FINANCIAL	56058	359 546 €	0,017
DAIDO METAL	290300	2 753 844 €	0,646
DAIHEN CORP	150000	880 339 €	0,111
DAI-ICHI MUTUAL LIFE	43800	692 849 €	0,004
DAIKYONISHIKAWA	47200	576 280 €	0,004
DAIMLERCHRYSLER	405512	28 677 809 €	0,038
DAISEKI	52300	1 018 615 €	0,116
DAIWA SECURITIES	1053000	6 165 428 €	0,060
DALATA HOTEL GROUP	728711	3 202 685 €	0,398
DANAHER	360797	26 626 630 €	0,052
DANSKE BANK	69859	2 012 467 €	0,007
DARDEN RESTAURANTS	14426	994 604 €	0,012
DASSAULT AVIATION	2803	2 975 665 €	0,034
DASSAULT SYSTEMES	428690	31 032 869 €	0,167
DAVIDE CAMPARI	1029860	9 567 399 €	0,177
DAVITA	46894	2 854 321 €	0,024
DBS GROUP HOLDINGS	349812	3 980 667 €	0,014
DBV TECHNOLOGIES	21256	1 410 336 €	0,088
DCC	30536	2 160 701 €	0,034
DCM JAPAN HOLDINGS	100000	843 760 €	0,106
DCT INDUSTRIAL	3371	153 025 €	0,004
DE LONGHI	280264	6 328 361 €	0,187
DECHRA PHARMACEUTICALS	100000	1 575 679 €	0,107
DEERE	28383	2 772 775 €	0,009
DELL TECHNOLOGIE INC	11042	575 472 €	0,005
DELPHI AUTOMOTIVE	14854	948 487 €	0,005
DELTA AIR LINES	230570	10 753 011 €	0,031
DELTA LLOYD NV	335414	1 783 396 €	0,073
DELTA PLUS GROUP	4764	264 783 €	0,129
DENA	61100	1 268 480 €	0,041
DENSO	91400	3 761 626 €	0,012
DENTSPLY INTER INC	13657	747 493 €	0,006
DERWENT LONDON	92445	3 002 080 €	0,092
DESCENTE LTD	114800	1 256 054 €	0,149
DEU, LUFTHANSA NOM	232970	2 858 542 €	0,050
DEUTSCHE BANK NOM	1163191	20 065 045 €	0,084
DEUTSCHE BORSE AG	112715	8 739 921 €	0,052
DEUTSCHE POST NOM	354554	11 074 494 €	0,029
DEUTSCHE TELEKOM	1439090	23 536 317 €	0,031
DEUTSCHE WOHN, POR	225570	6 731 009 €	0,067
DEVELOPERS DIVERS RE	4971	71 967 €	0,001
DEVON ENERGY	13248	573 630 €	0,003
DEVOTEAM	5571	320 333 €	0,068
DEXCOM	2262	128 032 €	0,003
DEXUS PTY, UNIT	7961	52 578 €	0,001
DIA	1426077	6 652 649 €	0,229
DIAGEO	248634	6 145 944 €	0,010
DIALOG SEMICONDUCTOR	79486	3 195 735 €	0,104
DIAMOND OFFSHORE	1393	23 376 €	0,001
DIAMONDBACK ENERGY	31183	2 987 773 €	0,035
DIASORIN	48680	2 738 250 €	0,087
DICK S SPORTING	3400	171 169 €	0,004
DIEBOLD	955	22 772 €	0,001
DIGITAL REALTY TRUST	20370	1 897 659 €	0,013
DIGNITY PLC	394103	11 408 488 €	0,794
DIRECT ENERGIE	39372	1 405 580 €	0,096
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	106722	461 845 €	0,008
DISCOVER FINANCIAL	112309	7 676 090 €	0,028
DISCOVERY COM CL A	13147	341 654 €	0,003
DISCOVERY COM CL C	29422	747 022 €	0,008
DISH NETWORK CORP	15143	831 699 €	0,007
DISNEY WALT-DISNEY	61780	6 104 491 €	0,004

DNB NOR	101884	1 440 897 €	0,006
DOLLAR GENERAL	112239	7 882 003 €	0,041
DOLLAR TREE	93258	6 824 036 €	0,040
DOLLARAMA	4300	299 080 €	0,004
DOMETIC GROUP	410321	2 866 937 €	0,139
DOMINION RESOURCES	19304	1 401 748 €	0,003
DOMINOS PIZZA ENT	18491	825 024 €	0,003
DOMINO'S PIZZA INC	1605	242 314 €	0,003
DOMINO'S PIZZA UK	1800000	7 608 247 €	0,297
DOUGLAS EMMETT	4433	153 658 €	0,003
DOVER	11321	804 250 €	0,007
DOW CHEMICAL	167835	9 105 019 €	0,015
DOWA HOLDINGS	535000	3 887 879 €	0,173
DOWNER EDI	98224	410 672 €	0,023
DR PEPPER SNAPPLE	31800	2 733 639 €	0,017
DREAM OFFICE SER A	4686	64 768 €	0,004
DST SYSTEMS	4516	458 772 €	0,014
DTE ENERGY	6543	611 094 €	0,004
DTS	140200	2 837 715 €	0,556
DU PONT DE NEMOURS	212801	14 808 811 €	0,024
DUERR	52805	4 031 662 €	0,153
DUET	1057399	1 989 066 €	0,043
DUFREY GROUP-REG	5774	684 047 €	0,011
DUKE ENERGY	3190	234 755 €	0,000
DUKE REALTY	44444	1 119 159 €	0,012
DULUX GROUP	380557	1 630 287 €	0,098
DUN BRADSTREET	9178	1 055 677 €	0,025
DUNELM GROUP	456864	4 305 847 €	0,227
E TRADE FINANCIAL	17582	577 593 €	0,006
E,ON	2017349	13 516 238 €	0,101
EAGLE INDUSTRY	233900	2 952 726 €	0,470
EAST WEST BANCORP	871	41 975 €	0,001
EATON CORP	247170	15 721 863 €	0,055
EATON VANCE N,VTG	6165	244 788 €	0,005
EBARA	55000	1 488 773 €	0,056
EBAY	321625	9 053 374 €	0,029
ECHO ENTERTAINMENT	237457	842 821 €	0,029
ECOLAB	104987	11 667 766 €	0,036
EDENRED	974849	18 361 281 €	0,416
EDF	1248650	12 086 932 €	0,059
EDGEWELL PERS CARE	3439	237 983 €	0,006
EDISON INTL	93027	6 349 385 €	0,029
EDP ENERG,PORTUGAL	1877070	5 432 241 €	0,051
EDWARDS LIFESCIEN	29400	2 611 785 €	0,014
EI TOWERS	80963	4 145 306 €	0,286
ElIFFAGE	164940	10 927 275 €	0,168
EKINOPS	20303	170 545 €	0,276
ELDORADO GOLD	61445	187 665 €	0,009
ELECTROLUX B	28141	664 612 €	0,009
ELECTRONIC ARTS A	83992	6 271 827 €	0,028
ELEKTA S,B	800000	6 729 284 €	0,217
ELEMENT FINANCIAL	10336	91 051 €	0,003
ELI LILLY ORD	134589	9 385 182 €	0,012
ELIOR	387647	8 419 693 €	0,225
ELIS	706008	11 966 836 €	0,619
ELISA CORP,S,A	184382	5 702 935 €	0,110
EMCOR GROUP	4484	300 818 €	0,007
EMERA INC	6332	203 195 €	0,003
EMERSON ELECTRIC	43216	2 284 230 €	0,007
EMPIRE CL,A	8489	94 346 €	0,005
EMS CHEMIE HOL,NOM	1771	854 937 €	0,015
ENAGAS	628282	15 157 303 €	0,263
ENBRIDGE	66842	2 669 994 €	0,007
ENCANA	23966	267 033 €	0,002
ENDESA	51008	1 026 536 €	0,005
ENDO INTERNATIONAL	7955	124 218 €	0,004

ENDURANCE SPECIAL	871	76 303 €	0,001
ENEL ENERG,ELET	863962	3 618 273 €	0,008
ENERGEN CORP	27859	1 523 232 €	0,029
ENERGIZER HLDG INC	318789	13 482 984 €	0,515
ENGIE	1162025	14 083 743 €	0,048
ENI	908373	14 052 530 €	0,025
ENSCO	7429	68 462 €	0,002
ENTERGY	237953	16 574 930 €	0,133
ENTERTAINMENT ONE	850000	2 293 287 €	0,198
EOG RESOURCES	223147	21 389 108 €	0,039
EQUIFAX	12083	1 354 419 €	0,010
EQUINITY GROUP PLC	944922	2 158 620 €	0,315
EQUINIX INC	11334	3 840 611 €	0,015
EQUITABLE CORP	33500	2 077 175 €	0,019
EQUITY RESIDENTIAL	35988	2 195 959 €	0,010
ERSTE BANK OSTERR	357364	9 943 653 €	0,083
ESI GROUP	28563	1 290 762 €	0,480
ESPRIT HOLDINGS	449741	334 928 €	0,023
ESSEX PROPERTY TRUST	3871	853 290 €	0,006
ESSILOR INTL	222978	23 936 688 €	0,102
ESTERLINE TECHN	337	28 500 €	0,001
EULER HERMES	94241	7 869 124 €	0,221
EUR,AERO,DEFENCE	585300	36 780 252 €	0,076
EURAZEO	111794	6 213 511 €	0,160
EUROFINS SCIENT	43016	17 421 480 €	0,254
EURONEXT	52894	2 073 709 €	0,076
EUROPCAR GROUP	671031	6 464 713 €	0,468
EUTELSAT COMM,PROM	668729	12 301 270 €	0,287
EVEREST REINS,GRP	8993	1 845 068 €	0,022
EVERSOURCE ENERGY	99870	5 229 505 €	0,032
EVONIK INDUSTRIES	413406	11 732 462 €	0,089
EXEDY	80500	2 152 847 €	0,166
EXELON	49705	1 672 463 €	0,005
EXOR NV	17312	709 446 €	0,007
EXPEDIA	9512	1 021 587 €	0,007
EXPEDITORS INTL	12699	637 629 €	0,007
EXPERIAN	105470	1 944 819 €	0,011
EXPRESS SCRIPTS	74412	4 853 095 €	0,012
EXTRA SPACE STORAGE	15761	1 154 188 €	0,013
EXTRACTION OIL REG	5868	111 491 €	0,004
EXXON MOBIL	62896	5 382 311 €	0,002
F N B	3536	53 740 €	0,002
F5 NETWORKS	9852	1 351 772 €	0,015
FACEBOOK CL A	453589	49 476 572 €	0,019
FAIRFAX FCIAL VTG	3333	1 528 121 €	0,014
FAIRFAX MEDIA	657322	401 632 €	0,029
FAIVELEY	61432	6 151 800 €	0,416
FAROE PETROLEUM	792728	961 192 €	0,217
FASTENAL	27512	1 225 422 €	0,010
FAURECIA	528246	19 457 941 €	0,383
FDAL REALTY INV	3740	503 903 €	0,005
FE NEW N,V	127461	7 039 595 €	0,066
FEDEX	54228	9 573 125 €	0,020
FERMENTALG	45966	138 358 €	0,380
FERROTEC	60000	739 875 €	0,194
FERROVIAL	400564	6 807 585 €	0,055
FIAT CHRYSLER	2834145	24 557 866 €	0,185
FIDELITY NAT FIN	22905	737 477 €	0,006
FIDELITY NATIONAL	29044	2 082 852 €	0,009
FIELMANN	54950	3 448 113 €	0,065
FIFTH THIRD BCP	664817	16 999 397 €	0,088
FIGEAC AERO	51116	1 104 106 €	0,167
FIH MOBILE LTD	719654	215 606 €	0,009
FINANCIERE ODET	5073	3 652 560 €	0,077
FINECOBANK	995297	5 304 933 €	0,164
FINMECCANICA	431757	5 759 638 €	0,075

FINNING INTL	21145	393 016 €	0,013
FIRESTONE DIAMONDS	3857866	2 350 153 €	1,225
FIRST AMER, FINL	1546	53 690 €	0,001
FIRST CAPITAL	25768	376 559 €	0,011
FIRST HORIZON NATL	3313	62 852 €	0,001
FIRST PACIFIC	1268919	841 017 €	0,030
FIRST REPUBLIC BK	18552	1 620 651 €	0,011
FIRST SOLAR	2842	86 466 €	0,003
FIRSTENERGY	8157	239 509 €	0,002
FISERV	15154	1 526 966 €	0,007
FISHER PAYKEL HEA,	149107	839 845 €	0,026
FISHER PLC	250000	4 568 885 €	0,498
FLEETCOR TECHN	25606	3 435 659 €	0,028
FLETCHER BUILDING	563742	3 950 461 €	0,081
FLEXTRONICS INTL	218207	2 972 870 €	0,040
FLIR SYSTEMS	8430	289 246 €	0,006
FLOWERS FOODS	4713	89 233 €	0,002
FLOWSERVE	15546	708 211 €	0,012
FLUOR	23577	1 173 988 €	0,017
FMC TECHNOLOGIES	43224	1 456 031 €	0,019
FONC,DES REGIONS	111979	9 287 538 €	0,164
FONC,FIN,PARTICIP	63060	4 556 085 €	0,252
FONDIARIA SAI	1235914	2 508 905 €	0,044
FOOT LOCKER	19932	1 339 635 €	0,015
FORD MOTOR	250170	2 877 044 €	0,006
FORTESCUE METALS	695257	2 811 385 €	0,022
FORTINET	4076	116 396 €	0,002
FORTIS	113208	3 318 324 €	0,028
FORTIVE	118698	6 035 339 €	0,034
FORTUNE BRANDS	5621	284 900 €	0,004
FOSSIL GROUP	289	7 086 €	0,001
FOSTER ELECTRIC	146400	2 633 564 €	0,544
FP	12000	522 838 €	0,027
FRANCO NEVADA	37775	2 143 997 €	0,021
FRANKLIN RESOURCES	24669	925 716 €	0,004
FRAPORT AG	73235	4 113 610 €	0,079
FREENET AG	51176	1 369 470 €	0,040
FREEPORT MCMORAN	92133	1 152 154 €	0,007
FRESENIUS	483209	35 883 100 €	0,088
FRESENIUS MED,CARE	152725	12 286 726 €	0,050
FRESNILLO PLC	49298	705 165 €	0,007
FRONTIER COMM, B	187997	602 446 €	0,016
FST QUANTUM MINE	30215	285 178 €	0,004
FTI CONSULTING	587	25 088 €	0,001
FUCHS PETR,ORD,DEM	35920	1 327 244 €	0,026
FUCHS PETROLUB PF	44780	1 785 826 €	0,032
FUGRO	103026	1 498 513 €	0,122
FUJI ELECTRIC HOLD	180000	886 679 €	0,024
FUJI HEAVY IND,	115000	4 460 872 €	0,015
FUJI MACHINE MFG	279700	3 039 802 €	0,286
FUJIKURA	150000	774 259 €	0,051
FUJIMORI KOGYO	700	16 564 €	0,004
FUJITEC	113000	1 257 487 €	0,121
FUKUOKA FIN,GRP	435000	1 835 177 €	0,051
FULTON FINANCIAL	3619	64 506 €	0,002
FURUKAWA ELECTRIC	30000	834 005 €	0,042
FUYO GENERAL LEASE	17500	795 191 €	0,058
G4S	226902	624 672 €	0,015
GALAXY	854934	3 533 628 €	0,020
GALENICA NOM,	478	512 334 €	0,007
GALIFORM	1009713	4 539 923 €	0,161
GALLAGHER	22873	1 126 789 €	0,013
GALLIFORD TRY	145000	2 193 006 €	0,175
GALP ENERGIA CL,B	697294	9 894 602 €	0,084
GAM HOLDING	182104	2 004 503 €	0,114
GAMESA CORPORACION	109557	2 111 163 €	0,039

GAMESTOP CL,A	2321	55 585 €	0,002
GANNETT CO INC	10276	94 601 €	0,009
GAP	295893	6 295 178 €	0,074
GARMIN	21141	971 915 €	0,011
GARTNER CL,A	2175	208 416 €	0,003
GAS NATURAL SDG	414884	7 430 572 €	0,041
GAZTRANSPORT TECHN	38982	1 601 965 €	0,105
GEA GROUP	144365	5 519 074 €	0,075
GEBERIT NOM,	7996	3 044 746 €	0,022
GECINA NOM,	112192	14 747 638 €	0,177
GEMALTO	134503	7 386 905 €	0,150
GENERAL ELECTRIC	423135	12 677 000 €	0,005
GENERAL GROWTH PRO	7140	169 099 €	0,001
GENERAL MILLS	32075	1 878 429 €	0,006
GENERAL MOTORS	92975	3 071 106 €	0,006
GENESEE WYOMING A	4546	299 159 €	0,007
GENFIT	19142	402 173 €	0,061
GENMAB	15473	2 440 953 €	0,026
GENPACT	1500	34 615 €	0,001
GENTEX	16089	300 348 €	0,006
GENTING SINGAPORE	1989288	1 181 458 €	0,017
GENUINE PARTS	10972	993 852 €	0,007
GENUS PLC	255957	5 385 412 €	0,419
GENWORTH FCIAL C,A	41888	151 309 €	0,008
GEO GROUP REIT	3518	119 840 €	0,003
GEORGE WESTON	19090	1 533 057 €	0,015
GEORGIA WORLDWIDE PL	10352	250 470 €	0,010
GESTEVISION TELEC	194129	2 164 538 €	0,058
GETINGE B	26926	410 550 €	0,012
GIBSON ENERGY	22783	305 717 €	0,016
GILEAD SCIENCES	334303	22 696 789 €	0,025
GIVAUDAN NOM,	1275	2 219 356 €	0,014
GJENSIDIGE FORSIKR	101213	1 527 281 €	0,020
GLANBIA	274479	4 331 279 €	0,093
GLAXOSMITHKLINE	445112	8 145 091 €	0,009
GLOBAL LOGISTIC PR	994922	1 436 428 €	0,021
GLOBAL PAYMENTS	13920	916 034 €	0,009
GLORY LTD	73700	2 210 626 €	0,107
GOLDCORP	76056	982 929 €	0,009
GOLDEN AGRI-RESOURCE	1558867	439 896 €	0,012
GOLDMAN SACHS	49232	11 176 679 €	0,012
GOOD RESOURCES HOL	465913	27 347 €	0,006
GOODMAN GRP UNIT	697072	3 412 140 €	0,039
GPE BRUXEL,LAMBERT	47352	3 774 901 €	0,029
GPE EUROTUN,REGPT	1247594	11 270 764 €	0,227
GRAFTON UNIT	460500	2 967 139 €	0,195
GRAHAM HOLDINGS	355	172 308 €	0,008
GRAINGER (W,W,)	8317	1 831 356 €	0,014
GRAND CITY PROP	210125	3 633 061 €	0,137
GRANDVISION NV	487505	10 191 292 €	0,192
GREAT EAGLE HOLD	220742	997 404 €	0,033
GREAT-WEST LIFECO	62644	1 557 630 €	0,006
GREEN REIT PLC	1941165	2 663 278 €	0,281
GREGGS PLC	270868	3 078 045 €	0,268
GRENKELEASING AG	21808	3 249 392 €	0,148
GRIFOLS CL,B	527872	8 026 294 €	0,077
GRIFOLS CL A	868562	16 398 451 €	0,126
GROUPE CGI CL,A	15835	721 416 €	0,006
GROUPE DANONE	645367	38 851 093 €	0,098
GROUPE FNAC	93500	6 005 505 €	0,358
GROUPE GORGE	13870	293 073 €	0,103
GROUPE GUILLIN	10443	341 486 €	0,056
GROUPE OPEN	15520	352 614 €	0,181
GUERBET	55301	3 936 878 €	0,448
GULFPORT ENERGY	66096	1 356 072 €	0,042
GUOTAI JUNAN INTER	348002	101 707 €	0,005

GVC HOLDINGS	600652	4 521 074 €	0,205
GYM GROUP PLC	825864	1 644 762 €	0,644
HAIR CELESTIAL GRP	8183	302 804 €	0,008
HAITONG INTERNATIO	210898	114 764 €	0,004
HAKUTO	153100	1 294 285 €	0,634
HALLIBURTON	52481	2 691 346 €	0,006
HALMA	613991	6 455 681 €	0,162
HAMAMATSU	123500	3 086 978 €	0,074
HANCOCK HOLDING	1116	45 603 €	0,001
HANESBRANDS	31586	645 945 €	0,008
HANG LUNG GROUP	273000	901 359 €	0,020
HANG LUNG PROPERT	684962	1 377 018 €	0,015
HANG SENG BANK	135784	2 395 998 €	0,007
HANGAR 8 PLC	278606	443 890 €	0,648
HANNOVER RUCK,NOM	61845	6 357 666 €	0,051
HANOVER INSURANCE	1126	97 158 €	0,003
HANWA	240000	1 492 431 €	0,113
HARGREAVES LANSDOWN	36184	514 189 €	0,008
HARLEY-DAVIDSON	11275	623 639 €	0,006
HARMAN INTL IND,	4739	499 443 €	0,007
HARMONIC DRIVE SYS	20800	489 647 €	0,022
HARRIS	44873	4 359 456 €	0,037
HARTFORD FINANCIAL	24374	1 101 134 €	0,006
HARVEY NORMAN	268463	947 343 €	0,024
HASBRO	15008	1 106 871 €	0,012
HASEKO	560700	5 419 184 €	0,186
HAVAS ADVERTISING	2487287	19 898 296 €	0,592
HBS TECHNOLOGIE	8272	251 469 €	0,338
HCA HOLDINGS	25252	1 772 129 €	0,007
HCP	23420	659 912 €	0,005
HD SUPPLY HOLDINGS	8166	329 117 €	0,004
HEALTHSCOPE LTD	711258	1 118 207 €	0,041
HEIDELBERGCEMENT	15000	1 329 450 €	0,008
HEINEKEN	120533	8 589 182 €	0,021
HEINEKEN HOLDING	296057	19 581 210 €	0,103
HEIWA	35000	760 197 €	0,035
HEIWADO CO LTD	30000	673 545 €	0,051
HELLA HUECK	17339	621 516 €	0,016
HELMERICH PAYNE	17508	1 284 778 €	0,016
HENDERSON LAND	305763	1 542 341 €	0,008
HENKEL PF	253784	28 741 038 €	0,058
HENKEL POR	266250	26 353 425 €	0,061
HENNES MAURITZ S,B	97990	2 591 387 €	0,007
HERA	2384184	5 226 131 €	0,160
HERBALIFE	10266	468 552 €	0,011
HERMES INTL	55491	21 641 490 €	0,053
HERSHEY FOODS	21012	2 060 461 €	0,014
HERTZ GLBL HDGS	1186	45 157 €	0,004
HERTZ RENT CAR HOLD	15825	323 477 €	0,019
HESS	7374	435 484 €	0,002
HEWLETT PACKARD	130123	1 830 790 €	0,008
HEWLETT PACKARD ENT	231393	5 076 496 €	0,028
HEXAGON B	29329	996 304 €	0,009
HEXCEL	2327	113 487 €	0,003
HI LEX	160300	3 841 337 €	0,419
HIGHWOODS PROP,	240	11 607 €	0,000
HIKMA PHARMACEUT	49150	1 089 983 €	0,020
HILL & SMITH HLDGS	355132	4 988 323 €	0,452
HILTON GRAND VACAT	-10692	263 562 €	0,000
HILTON WORLDWIDE	261913	6 754 239 €	0,026
HINO MOTORS	130000	1 257 511 €	0,023
HITACHI	1191000	6 118 575 €	0,025
HITACHI CAPITAL	35000	818 520 €	0,028
HITACHI CHEMICAL	30000	712 806 €	0,014
HITACHI METALS	150000	1 931 381 €	0,035
HITACHI TRANSPORT	21200	408 936 €	0,019

HKG AND CHINA GAS	2453113	4 121 694 €	0,019
HKG EXCHANGES	162651	3 643 793 €	0,013
HKG LAND HOLD	385918	2 316 057 €	0,016
HKT TRUST LTD	318000	369 810 €	0,004
HLS US	7868	307 633 €	0,009
HOCHTIEF	71996	9 579 068 €	0,112
HOLLYFRONTIER	29009	901 005 €	0,005
HOLOGIC	19518	742 415 €	0,007
HOME DEPOT	202079	25 688 317 €	0,016
HONDA MOTOR	50900	1 412 960 €	0,003
HONEYWELL INTL	279877	30 740 697 €	0,037
HONGKONG ELECTRIC	226393	1 892 226 €	0,011
HOPEWELL HOLDINGS	24000	78 653 €	0,003
HOPEWELLE HIGHWAY	3056009	1 520 970 €	0,099
HORIBA	21300	936 695 €	0,050
HOSHIZAKI ELECTRIC	34000	2 556 478 €	0,047
HOSPITALIT,PROP,PB	9310	280 161 €	0,006
HOST HOTELS	24798	442 943 €	0,003
HOYA	11700	467 065 €	0,003
HR REAL ESTATE	26518	419 391 €	0,009
HSBC HOLDINGS	1793178	13 799 656 €	0,009
HUABAO INTERNATIONAL	2387624	960 580 €	0,077
HUB GROUP	7528	312 254 €	0,023
HUBELL	1456	161 095 €	0,003
HUFVUDSTADEN LIB,A	275000	4 129 879 €	0,135
HUGO BOSS	85616	4 976 858 €	0,122
HUHTAMAKI	149583	5 277 288 €	0,139
HUMANA	51857	10 031 177 €	0,035
HUMMINGBIRD RESOUR	2553478	545 935 €	0,744
HUNT TRANSPORT SCE	10523	968 445 €	0,009
HUNTINGTON	4222	737 284 €	0,009
HUNTINGTON BANCSH	73004	915 016 €	0,007
HUSQVARNA AB CL,B	69004	510 221 €	0,015
HUTCHINSON TELEC	1460194	446 398 €	0,030
HUTCHISON PORT HOL	5043182	2 079 909 €	0,058
HYDRO ONE	23070	384 595 €	0,004
HYSAN DEVELOPMENT	413652	1 621 193 €	0,040
IAC INTERACTIVE CORP	8289	509 167 €	0,011
IAMGOLD	68677	251 995 €	0,015
IBERDROLA	1625578	10 133 853 €	0,025
IBM	104142	16 389 221 €	0,011
IBSTOCK PLC	503097	1 098 020 €	0,124
ICA GRUPPEN AB	17940	520 301 €	0,009
ICADE	165610	11 226 702 €	0,223
ID LOGISTICS	33024	4 458 240 €	0,591
IDEXX LABORATORIES	3564	396 255 €	0,004
IG GROUP HOLDINGS	522235	3 022 918 €	0,142
IGM FINANCIAL	30891	834 272 €	0,013
IHI	1336000	3 301 425 €	0,086
IHS MARKIT	16198	543 798 €	0,004
IIDA GROUP HOLDING	84100	1 515 595 €	0,029
ILIAD	116769	21 327 858 €	0,199
ILLINOIS TOOL WRK	20538	2 384 530 €	0,006
ILLUMINA	34583	4 198 158 €	0,024
ILUKA RESOURCES	55685	277 928 €	0,013
IMA INDUSTRIA	188120	10 835 712 €	0,479
IMCD	195210	7 904 053 €	0,371
IMERYS	113495	8 179 585 €	0,143
IMI	42311	515 504 €	0,016
IMMOAEST NV	1227354	- €	0,000
IMMOFINANZ	414412	767 905 €	0,042
IMMOFINANZ DA10	720883	- €	0,000
IMPERIAL TOBACCO	104532	4 338 151 €	0,011
IMPLENIA	51922	3 644 711 €	0,281
IMS INTL METAL SCE	71591	1 418 218 €	0,298
INABA DENKISANGYO	60500	1 979 442 €	0,217

INABATA	207700	2 176 260 €	0,327
INCYTE	46955	4 463 786 €	0,025
INDITEX	335748	10 888 308 €	0,011
INDL ALLIANCE AND	8746	330 128 €	0,008
INDREDION	1731	205 078 €	0,002
INDUSTRIVARDEN S,C	17638	312 558 €	0,004
INFINEON TECHN	1158423	19 125 564 €	0,102
INFORMA	137500	1 095 361 €	0,017
INFOTEL	6746	275 372 €	0,101
ING GROEP	1427591	19 086 892 €	0,037
INGENICO	270967	20 558 266 €	0,441
INGERSOLL-RAND	15307	1 089 014 €	0,006
INGEVITY CORP	6226	323 829 €	0,015
INMARSAT	55144	485 482 €	0,012
INNATE PHARMA	35468	518 187 €	0,066
INPEX HOLDINGS	200000	1 903 743 €	0,014
INSUR,AUSTRAL,GRP	598202	2 459 996 €	0,025
INTACT FINANCIAL	20916	1 421 067 €	0,016
INTAGE HOLDINGS IN	6000	96 520 €	0,029
INTEL	393525	13 532 260 €	0,008
INTER PARFUMS	87985	2 410 789 €	0,248
INTER PIPELINE	28654	600 449 €	0,008
INTERCONTINENTALEX	237645	12 711 952 €	0,040
INTERPUBLIC GROUP	104335	2 315 698 €	0,026
INTERTEK GROUP	22000	897 165 €	0,014
INTERTRUST	324071	5 418 467 €	0,352
INTESA SA,EPAR,NCV	1090474	2 436 119 €	0,007
INTESA SANPAOLO	5555736	13 478 216 €	0,035
INTL FLAVORS	10500	1 172 994 €	0,013
INTL PAPER	89400	4 497 335 €	0,022
INTRUM JUSTITIA	31161	999 676 €	0,043
INTUIT	46534	5 056 423 €	0,018
INTUITIVE SURGICAL	30623	18 412 124 €	0,079
INVESCO	28534	820 784 €	0,007
INVESTEC	83048	521 482 €	0,013
INVESTOR SIE B	52299	1 858 465 €	0,011
INWIT	1122053	4 939 277 €	0,187
ION BEAM APPLICAT	193706	8 065 918 €	0,655
IOOF HOLDINGS	26430	167 115 €	0,009
IPSEN PROMESSE	357320	24 547 884 €	0,428
IPSOS	100315	2 993 901 €	0,226
IRISH CONTINENTAL	530605	2 387 723 €	0,282
IRISO ELECTR	8400	456 801 €	0,068
IRON MOUNTAIN REIT	17693	544 839 €	0,007
ISS AS TEMP	25923	831 148 €	0,014
ISUZU MOTORS	220000	2 648 495 €	0,026
ITALIANA PER IL GAS	352932	1 319 260 €	0,044
ITOCHU	793600	10 011 861 €	0,048
ITT INC	3543	129 560 €	0,004
ITV	547912	1 324 848 €	0,014
IWG PLC	1199892	3 457 983 €	0,130
JABIL CIRCUIT	11850	265 930 €	0,006
JACANA MINERALS LMTD	8609	- €	0,000
JACOBS ENGINEERING	17987	972 040 €	0,015
JACQUES BOGART	24998	332 223 €	0,159
JAPAN TOBACCO	120600	3 768 358 €	0,006
JARDIN,MATHES,HOLD	86584	4 535 450 €	0,012
JARDINE CYCLE	42381	1 146 718 €	0,011
JARDINE STRATEGIC	20039	630 761 €	0,002
JAZZ PHARMACEUTICA	2987	308 768 €	0,005
JCDECAUX	398654	11 134 406 €	0,188
JERON,MARTINS ESC	844705	12 450 952 €	0,134
JGC	183600	3 169 922 €	0,071
JM AB	200000	5 493 634 €	0,274
JOHN WOOD CONSO	125000	1 282 802 €	0,033
JOHNSON ELECTRIC LTD	396839	994 809 €	0,045

JOHNSON JOHNSON	360213	39 345 949 €	0,013
JOHNSON MATTHEY PL	140171	5 225 212 €	0,072
JONES LANG LASALLE	2100	201 170 €	0,005
JPMORGAN CHASE	675759	55 284 422 €	0,019
JSP	114700	2 535 094 €	0,365
JTEKT	90000	1 368 061 €	0,026
JULIUS BAER GROUP	25916	1 093 452 €	0,012
JUMBO	214767	3 234 391 €	0,158
JUNIPER NETWORKS	41240	1 104 947 €	0,011
JUPITER FUND MANAG	700000	3 637 769 €	0,153
JUST EAT	657865	4 497 004 €	0,097
JX HOLDING INC 1 SEC	1050600	4 224 748 €	0,042
K S HOLDINGS	35000	582 381 €	0,029
K&S NOM	240248	5 451 227 €	0,126
KAKAKU,COM	68400	1 075 311 €	0,031
KANAMOTO	75300	1 894 424 €	0,209
KANEKA	90000	696 468 €	0,026
KANSAI PAINT	33400	584 537 €	0,012
KAO	32400	1 459 334 €	0,006
KAR AUCTION SVCES	119660	4 835 183 €	0,087
KARDEX	34489	3 064 438 €	0,446
KATO SANGYO	12700	282 553 €	0,041
KAUFMAN ET BROAD	7706	260 463 €	0,037
KAWASAKI HEAVY	806000	2 404 488 €	0,048
KBC ANCORA	192537	7 658 159 €	0,246
KBC BANCASSURANCE	168456	9 910 266 €	0,040
KBR	18731	296 393 €	0,013
KDDI	268500	6 459 280 €	0,010
KELLOGG	16685	1 166 012 €	0,005
KEMPER	976	40 992 €	0,002
KERING	106407	22 696 613 €	0,084
KERLINK	20082	313 279 €	0,559
KERRY GROUP CL,A	196850	13 366 115 €	0,112
KERRY LOGISTIC	495106	592 118 €	0,029
KERRY PROPERTIES	367868	946 925 €	0,025
KESKO CL,B	150237	7 133 253 €	0,220
KEYCORP	77200	1 337 231 €	0,007
KEYENCE	9600	6 258 454 €	0,016
KEYERA	7116	203 551 €	0,004
KEYSIGHT TECHNOLOGIE	16512	572 499 €	0,010
KIMCO REALTY	40125	957 142 €	0,009
KINDEN	50000	592 583 €	0,023
KINDER MORGAN	54186	1 063 941 €	0,002
KINEPOLIS GROUP NV	54728	2 325 940 €	0,200
KINGFISHER	218699	897 496 €	0,010
KINGSPAN GROUP	480163	12 388 205 €	0,270
KINGSTON FINANCIAL	654000	267 913 €	0,005
KINROSS GOLD	46586	138 001 €	0,004
KINTETSU WORLD EXP	62800	827 493 €	0,087
KION GROUP	69541	3 675 937 €	0,064
KITZ	200000	1 038 849 €	0,181
KIWI PROPERTY	797808	730 482 €	0,061
KLA TENCOR	33130	2 471 361 €	0,021
KLEPIERRE	264149	9 864 644 €	0,084
KLOCKNER	97413	1 160 189 €	0,098
KLX INC	1271	54 359 €	0,002
KOHL S	29748	1 392 706 €	0,017
KOITO MFG	22300	1 122 062 €	0,014
KON,BAM GROEP	1076304	4 724 975 €	0,396
KON,DSM NOM	172700	9 836 992 €	0,095
KON,PHILIPS ADR	84529	2 449 918 €	0,008
KON,PHILIPS ELEC	546015	15 834 435 €	0,059
KONE B	231170	9 840 907 €	0,051
KONECRANES A	97806	3 303 887 €	0,155
KONICA	26000	245 373 €	0,007
KONINKLIJKE AHOLD NV	1770576	35 464 637 €	0,138

KONINKLIJKE KPN	3466064	9 753 504 €	0,081
KONINKLIJKE VOPAK	71581	3 212 197 €	0,056
KONOIKE TRANSPORT	45000	562 222 €	0,079
KORIAN PROMESSES	450578	12 544 092 €	0,562
KOWLOON DEV CO	473002	425 130 €	0,041
KROGER	85316	2 791 425 €	0,009
KUBOTA	100700	1 365 769 €	0,008
KUEHNE UND NAGEL	13637	1 712 258 €	0,011
KUMAGAI GUMI	200000	487 722 €	0,053
KURODA ELECTRIC	21000	394 494 €	0,053
KYB	325000	1 497 917 €	0,126
KYORITSU MAINT	20600	1 140 344 €	0,106
KYOWA EXEO	147700	2 019 426 €	0,125
LABORATORY AMERICA	20961	2 551 290 €	0,020
LAGARDERE	337695	8 913 460 €	0,258
LAM RESEARCH	13591	1 362 386 €	0,008
LAMAR ADVERTISING CO	4839	308 485 €	0,006
LAMB WESTON HOLDI IN	2252	80 814 €	0,002
LANXESS	48904	3 049 164 €	0,053
LAR ESPANA REAL ES	193009	1 356 853 €	0,213
LAS VEGAS SANDS	48791	2 470 659 €	0,006
LAUDER ESTEE CL,A	66314	4 809 062 €	0,030
LBRTY BROADBAND CORP	10129	711 311 €	0,006
LDLC COM	3057	110 847 €	0,048
LE NOBLE AGE	9208	325 503 €	0,095
LEAP WIRELESS INTL	2641	- €	0,000
LEAR CORP	2935	368 339 €	0,004
LECTRA	14985	270 030 €	0,048
LEG IMMOBILIEN	42134	3 109 489 €	0,067
LEGAL GL GROUP	565593	1 640 591 €	0,009
LEGG MASON	4928	139 745 €	0,005
LEGGETT AND PLATT	11502	533 034 €	0,009
LEGRAND PROMESSES	469812	25 346 357 €	0,176
LEIDOS HOLDINGS	18789	910 993 €	0,012
LEKOIL LTD	3290175	1 011 798 €	0,613
LEM HDG SA REGISTER	8971	7 966 784 €	0,787
LEND LEASE	219795	2 206 098 €	0,038
LENNAR CL,A	9796	398 713 €	0,005
LENZING	9643	1 108 945 €	0,036
LEONI	21783	737 246 €	0,067
LEOPALACE21	171900	902 672 €	0,064
LEVEL3 COMMUCATION	10857	580 138 €	0,003
LI AND FUNG	988272	124 476 €	0,012
LI AND FUNG LTD	2838381	1 183 577 €	0,034
LIBERTY SIRIUS XM C	10959	352 434 €	0,002
LIBERTY BRAVES SER A	557	10 821 €	0,000
LIBERTY BRAVES SER C	1397	27 271 €	0,000
LIBERTY EXPEDIA HOLD	2039	76 688 €	0,004
LIBERTY GLOBAL CL A	77307	2 176 836 €	0,007
LIBERTY GLOBAL INC-A	31950	926 618 €	0,003
LIBERTY INTERACT	46311	877 264 €	0,009
LIBERTY LILAC C	36627	735 144 €	0,003
LIBERTY MEDIA C	3493	103 755 €	0,001
LIBERTY MEDIA SERI A	11508	342 049 €	0,003
LIBERTY PROP,PB	25949	971 781 €	0,018
LIBERTY SERIUSXM A	7793	255 050 €	0,002
LIBTY BROADBAND CORP	5589	383 957 €	0,003
LIFEPOINT	801	43 135 €	0,002
LIFESTYLE INTL	470574	575 439 €	0,029
LIMITED BRANDS NV	25879	1 615 429 €	0,009
LINCOLN ELEC,HOLD	3802	276 368 €	0,006
LINCOLN NATIONAL	15299	961 237 €	0,007
LINDE	14460	2 257 206 €	0,008
LINEAR TECHNOLOGY	6717	397 066 €	0,003
LINEDATA SERVICES	54301	2 539 658 €	0,742
LISI	429339	13 159 240 €	0,795

LKQ	70291	2 042 587 €	0,023
LLOYDS TSB GROUP	5767881	4 223 878 €	0,008
LOBLAW	46332	2 320 449 €	0,011
L'OCCITANE INTL	398952	716 173 €	0,027
LOEW'S	283628	12 592 841 €	0,084
LONDON STOCK EXCH,	66285	2 262 822 €	0,019
LOOMIS	300000	8 487 790 €	0,418
LOWES	64196	4 328 627 €	0,008
LULULEMON ATHLETIC	15398	948 771 €	0,012
LUNDIN PETROLEUM	77872	1 609 940 €	0,023
LUXOTTICA GROUP	140772	7 193 449 €	0,029
LVMH MOET VUITTON	254953	46 248 474 €	0,050
LYONDELLBASELL IND	35787	2 910 461 €	0,009
M AND T BANK	11617	1 722 918 €	0,007
MACAU LEGEND DEVEL	71588	13 744 €	0,001
MACERICH	6286	422 186 €	0,004
MACK CALI REALTY	9	248 €	0,000
MACQUARIE ATLAS ROAD	396255	1 373 807 €	0,075
MACQUARIE GROUP	57980	3 467 814 €	0,017
MACQUARIE INFRASTRUC	3655	283 113 €	0,004
MACY S	35309	1 198 782 €	0,012
MAEDA	100000	829 128 €	0,054
MAGELLAN FINANCIAL	9626	157 085 €	0,006
MAGELLAN HEALTH	2007	143 187 €	0,009
MAGNA INTL CL,A	22031	908 061 €	0,006
MAISONS DU MONDE	463672	11 612 665 €	1,025
MAISONS FRANCE	90769	4 310 620 €	0,005
MALLINCKRODT PLC	4617	218 079 €	0,004
MAN ORD,	193859	18 286 719 €	0,138
MANITOU BF	113517	2 122 768 €	0,287
MANPOWER	8897	749 634 €	0,013
MANULIFE FINANCIAL	110140	1 861 817 €	0,006
MANUTAN INTL	9000	627 300 €	0,118
MAPFRE	2238274	6 490 995 €	0,073
MARATHON OIL	133103	2 184 416 €	0,016
MARATHON PETROLEUM	101633	4 851 597 €	0,019
MARINE HARVEST	64975	1 114 287 €	0,014
MARKEL	1323	1 134 538 €	0,009
MARKS SPENCER GRP	351532	1 441 380 €	0,022
MARR	273419	4 743 820 €	0,411
MARRIOTT INTL CL,A	5378	421 572 €	0,001
MARSH MC LENNAN	28943	1 854 712 €	0,006
MARSHAALLS	700000	2 398 664 €	0,355
MARTIN MARIETTA	1091	229 144 €	0,002
MARUBENI	190400	1 025 819 €	0,011
MARVELL TECHNOLOGY	78024	1 026 018 €	0,015
MASCO	26541	795 664 €	0,008
MASTERCARD CL,A	194757	19 064 859 €	0,018
MATSUMOTOKIYOSHI	15000	702 320 €	0,027
MATSUSH,ELEC,IND	185000	1 788 783 €	0,008
MATTEL	37723	985 322 €	0,011
MAUREL ET PROM	412396	1 740 311 €	0,211
MAXIM INTEGRATED	5891	215 422 €	0,002
MAZDA MOTOR	125000	1 942 761 €	0,021
MC CARTHY AND STONE	3477640	6 559 279 €	0,647
MC CORMICK NON VTG	24024	2 125 774 €	0,021
MC GRAW HILL ORD	46624	4 753 681 €	0,018
MCDONALDS	21779	2 513 335 €	0,003
MCKESSON	13981	1 861 703 €	0,006
MEAD JOHNSON NUTRI	12510	839 258 €	0,007
MEDIASET	683318	2 808 437 €	0,058
MEDIAWAN BSA	137500	49 500 €	0,000
MEDIAWAN PREF	137500	1 364 000 €	0,000
MEDIBANK	1009857	1 955 099 €	0,037
MEDIOBANCA	623716	4 836 918 €	0,071
MEDNAX	3503	221 389 €	0,004

MEDTRONIC HOLDINGS	400579	27 052 138 €	0,029
MEGGITT	94245	506 335 €	0,012
MEKONOMEN AB	138496	2 478 821 €	0,386
MELCO CROWN ADR	25500	384 404 €	0,002
MELCO CROWN ENTER	2	- €	0,000
MELCO INTL DEV	255571	329 400 €	0,017
MELEXIS	25000	1 591 250 €	0,062
MERCADOLIBRE	19977	2 957 297 €	0,045
MERCIALYS	52042	1 001 548 €	0,057
MERCK AND CO, NEW	750310	41 877 933 €	0,027
MERCK KGAA	306610	30 400 382 €	0,237
MERCURY GENERAL	715	40 816 €	0,001
MERIDIAN ENERGY	1228909	2 112 295 €	0,048
MERLIN ENTERTAINMENT	766842	4 030 053 €	0,075
MERLIN PROPERTIES	375000	3 873 750 €	0,080
MERSEN	93583	1 901 607 €	0,453
METCASH	549405	859 978 €	0,056
METHANEX CORP	22518	935 092 €	0,025
METLIFE	102683	5 246 349 €	0,009
METRO	37 996	1 078 808 €	0,016
METRO	581 255	18 358 939 €	0,179
METROPOLE TV	31000	547 770 €	0,025
METSO	239847	6 499 854 €	0,160
METTLER TOLEDO	1809	717 872 €	0,007
MGM CHINA HOLDINGS	378320	743 904 €	0,010
MGM MIRAGE	357427	9 769 728 €	0,062
MICHAEL KORS HOLD	22918	933 885 €	0,014
MICHAEL PAGE INTL	170000	777 706 €	0,052
MICHELIN	392503	41 487 567 €	0,218
MICROCHIP TECHN,	153810	9 354 740 €	0,071
MICRON TECHNOLOGY	32087	666 838 €	0,003
MICROSOFT	1163235	68 531 332 €	0,015
MID AMERICA APARTM	5005	464 650 €	0,004
MIDDLEBY CORP	2035	248 522 €	0,004
MIE BANK	6700	127 061 €	0,050
MIGHTY RIVER POWER	1033427	2 022 242 €	0,075
MILlicom INTL SRD	7492	304 387 €	0,007
MINEBEA	70800	630 762 €	0,018
MINTH GROUP	126000	372 100 €	0,011
MIRAI INDUSTRY	65700	878 522 €	0,257
MIRVAC GROUP	1881459	2 751 275 €	0,051
MITSU,UFJ LEASE	275000	1 350 178 €	0,031
MITSUB,ELECTRIC	476000	6 304 966 €	0,022
MITSUBISHI	233200	4 720 080 €	0,015
MITSUBISHI CH,HDG	275000	1 694 429 €	0,018
MITSUBISHI GAS	75000	1 216 258 €	0,031
MITSUBISHI MATER	45000	1 313 193 €	0,034
MITSUBISHI TOKYO	2273100	13 307 397 €	0,016
MITSUBOSHI BELTING	133000	1 077 875 €	0,195
MITSUBI	420400	5 491 614 €	0,023
MITSUBI CHEMICALS	450000	1 920 407 €	0,044
MITSUBI MINING	350000	842 134 €	0,061
MITSUBI OSK	425000	1 119 323 €	0,035
MITSUBI SUMITOMO	45000	1 325 629 €	0,007
MIURA	123500	1 782 918 €	0,099
MIZUHO FCIAL GRP	934200	1 593 187 €	0,004
MOBILEONE	453560	583 395 €	0,049
MOBILEYE N,V,	2188	79 077 €	0,001
MOLSON COORS CL,B	11701	1 079 521 €	0,006
MONCLER SPA	434494	7 182 186 €	0,174
MONDELEZ INTL	401095	16 857 588 €	0,026
MONDI	50443	984 513 €	0,014
MONEYSUPERMKT,COM	717807	2 473 138 €	0,131
MONSANTO	19462	1 941 310 €	0,004
MONSTER BEVERAGE	129352	5 437 751 €	0,023
MOODY S	33786	3 019 679 €	0,018

MOOG CL,A	437	27 212 €	0,001
MORGAN STANLEY	434218	17 393 421 €	0,023
MORI SEIKI	70000	806 855 €	0,053
MORITA	113800	1 534 653 €	0,243
MOTOROLA SOLTN-ED	224532	17 645 373 €	0,135
MRC GLOBAL	14195	272 662 €	0,015
MSC INDUSTRIAL A	3512	307 631 €	0,008
MSCI	4242	316 838 €	0,005
MTR	140028	645 547 €	0,002
MTU AERO ENGINES	125829	13 816 024 €	0,242
MUNCHENER RUCKVERS	110086	19 776 950 €	0,068
MURATA MFG	60600	7 709 184 €	0,027
MURPHY USA INC	1923	112 071 €	0,005
MUSASHI SEIMITSU I	64700	1 598 819 €	0,207
MUSASHINO BANK	66400	1 816 246 €	0,196
MYLAN NV	22570	816 350 €	0,004
NABORS INDUSTRIES	18330	285 008 €	0,006
NACHI-FUJIKOSHI	150000	618 188 €	0,060
NAFCO	150800	2 191 746 €	0,506
NAKANISHI	140200	5 151 194 €	0,446
NASDAQ OMX GROUP	10145	645 587 €	0,006
NAT,AUSTRALIA BANK	466543	9 823 475 €	0,017
NAT,BANK CANADA	27361	1 054 824 €	0,008
NATEXIS BQ,POPUL	1886770	10 113 087 €	0,060
NATIONAL GRID TRAN	399962	4 458 808 €	0,011
NATIONAL OILWELL	41438	1 470 907 €	0,011
NATUREX	28300	2 405 500 €	0,306
NAVIENT CORPORATION	133704	2 082 727 €	0,044
NCC GROUP PLC	2889162	6 117 807 €	1,045
NCR	11841	455 341 €	0,010
NEC SYSTEM INTEGR	34700	595 442 €	0,070
NEOPOST	63904	1 899 227 €	0,185
NESTE OY	696885	25 436 303 €	0,272
NETAPP	29437	984 350 €	0,011
NETFLIX INC	95277	11 183 022 €	0,022
NEURONES	124446	2 782 613 €	0,513
NEW JERSEY RES	17321	582 977 €	0,020
NEW WORLD DEV	1816156	1 821 120 €	0,019
NEW YORK COMMUNITY	63407	956 440 €	0,013
NEWBELCO	91274	9 177 601 €	0,005
NEWCREST MING	199019	2 766 810 €	0,026
NEWELL RUBBERMAID	83667	3 541 817 €	0,017
NEWFIELD EXPLOR	35440	1 360 815 €	0,018
NEWMARKET	1069	429 566 €	0,009
NEWMONT MINING	68638	2 217 110 €	0,013
NEWS CL,A	24357	264 642 €	0,004
NEWS CORP - CLASS B	6686	74 800 €	0,001
NEXANS	103038	5 070 500 €	0,238
NEXITY	77330	3 438 092 €	0,141
NEXON CO LTD	346100	4 765 807 €	0,080
NEXT GROUP	15854	925 498 €	0,011
NEXTERA ENERGY INC	131154	14 854 380 €	0,027
NEXUS	158746	2 841 553 €	1,009
NH HOTELES	200000	769 000 €	0,057
NHK SPRING	80000	724 430 €	0,033
NIDEC	33500	2 746 263 €	0,011
NIELSEN HOLDINGS PLC	37760	1 501 808 €	0,011
NIFCO	42700	2 141 581 €	0,079
NIKE CL,B	53846	2 594 920 €	0,004
NIP,SUISAN KAISHA	154800	707 178 €	0,050
NIPPON DENSETSU	45000	684 031 €	0,069
NIPPON LIGHT METAL	475000	953 701 €	0,087
NIPPON SEIKI	168000	3 397 669 €	0,276
NIPPON SHOKUBAI	17500	1 038 442 €	0,043
NIPPON TELEG,TEL,	80000	3 194 257 €	0,004
NISHIMATSU CONST	175000	805 148 €	0,063

NISHIO RENT ALL	129000	3 764 485 €	0,485
NISOURCE	15274	320 613 €	0,005
NISSAN MOTOR	289200	2 763 391 €	0,007
NISSHIN FUDOSAN	491100	2 155 684 €	1,046
NISSHIN STEEL CO	75000	878 510 €	0,068
NISSIN KOGYO	57500	864 224 €	0,088
NITTA CORP	124800	3 231 063 €	0,412
NKSJ HOLDINGS 1 SEC	306200	9 856 480 €	0,074
NN GROUP N,V	764852	24 624 410 €	0,457
NOBLE ENERGY	7370	265 942 €	0,002
NOBLE GROUP	5218410	582 183 €	0,040
NOK	35000	673 138 €	0,020
NOKIA	2502311	11 480 603 €	0,043
NOKIAN RENKAAT	90683	3 211 992 €	0,067
NOMURA HOLDINGS	325000	1 820 485 €	0,009
NOMURA RL ESTATE	163100	2 635 675 €	0,085
NORD,AFFINERIE	12333	675 848 €	0,027
NORDEA BANK	297298	3 143 006 €	0,004
NORDSTROM	18925	859 991 €	0,011
NORFOLK SOUTHERN	97731	10 013 547 €	0,033
NORMA GROUP AG	62908	2 550 919 €	0,197
NORTHERN TRUST	18220	1 538 271 €	0,008
NORTHROP GRUMMAN	87180	19 223 820 €	0,049
NORWEGIAN CRUISE	4918	198 305 €	0,002
NOVARTIS	208902	14 439 961 €	0,008
NOVO NORDISK AS	172420	5 906 137 €	0,009
NOVOZYMES B NV	121037	3 963 730 €	0,047
NOW INC	13503	262 059 €	0,013
NTN	238000	915 081 €	0,045
NTT DOCOMO	233400	5 052 350 €	0,006
NUANCE CIONS INC	41968	592 864 €	0,014
NUCOR	27906	1 574 748 €	0,009
NVIDIA	162729	16 468 067 €	0,030
NVR	448	708 900 €	0,012
NWS HOLDINGS	501845	775 690 €	0,013
NXP SEMICONDUCTORS	163234	15 168 110 €	0,048
O REILLY AUTOMOT	30109	7 947 520 €	0,032
OAKLEY CAPITAL INV	1490592	2 859 471 €	0,785
OBARA GROUP INC	39400	1 668 612 €	0,189
OBAYASHI	100000	907 977 €	0,014
OBRASCON HUARTE	64129	211 305 €	0,021
OC OERLIKON CORP	415820	3 878 918 €	0,122
OCADO GROUP	669786	2 072 288 €	0,112
OCCIDENTAL PETROL	182602	12 331 586 €	0,024
OCEANEERING INTL	12253	327 715 €	0,012
OENEO	357550	2 831 796 €	0,570
OIL SEARCH	318751	1 569 027 €	0,021
OIL STATES INTL	5367	198 448 €	0,010
OKINAWA CELLULAR	170800	4 838 515 €	0,625
OLAM INTERNATIONAL	308946	399 412 €	0,011
OLD DOMN FREIGHT	6758	549 674 €	0,008
OLD MUTUAL	537700	1 305 825 €	0,011
OLD REP,INTL ORD	29867	538 017 €	0,011
OLYMPUS OPTICAL	13200	433 488 €	0,004
OMNICOM GROUP	19451	1 569 542 €	0,008
OMRON	33200	1 210 381 €	0,016
OMV	79608	2 671 644 €	0,024
ONE GAS-WI	12504	758 242 €	0,024
ONEOK	20790	1 131 599 €	0,010
ONTEX GROUP AIW	376660	10 640 645 €	0,503
OPEN HOUSE CO	55000	1 242 879 €	0,096
OPEN TEXT CORP	3700	216 907 €	0,003
OPHIR ENERGY PLC	1308874	1 479 690 €	0,185
ORACLE	734897	26 790 035 €	0,018
ORANGE	3630899	52 412 027 €	0,136
ORCHESTRA-PREMAMAN	52282	651 957 €	0,282

OREAL	275266	47 731 124 €	0,049
ORICA	194827	2 364 782 €	0,052
ORIGIN ENERGY	407809	1 845 024 €	0,023
ORIGIN ENTERPRISES	273022	1 687 549 €	0,217
ORION CL,B	207423	8 771 919 €	0,201
ORIX	1205300	17 870 695 €	0,091
ORKLA S,A	179582	1 546 791 €	0,018
ORORA LTD	657299	1 349 254 €	0,054
ORPEA	262006	20 111 581 €	0,435
OSRAM LICHT AG	50366	2 509 486 €	0,048
OUTFRONT MEDIA	447	10 540 €	0,000
OVERS,CHINESE BKG	586898	3 435 576 €	0,014
OVS	685387	3 276 150 €	0,302
OW BUNKER AS	41498	- €	0,113
OWENS AND MINOR	1874	62 701 €	0,003
OXFORD INSTRUMENTS	79333	680 316 €	0,138
P,P,G,INDUSTRIES	32057	2 880 039 €	0,013
PACCAR	29727	1 800 953 €	0,008
PACIFIC INDUSTRIAL	96200	1 162 025 €	0,175
PACIFIC METALS	449000	1 357 722 €	0,229
PACKAGING AMERICA	3443	276 876 €	0,004
PADDY POWER PLC	27426	2 783 739 €	0,033
PAL	14300	322 684 €	0,062
PALO ALTO NETWORKS	15115	1 792 018 €	0,016
PALTAC	60000	1 347 089 €	0,094
PANDORA	49070	6 097 825 €	0,042
PANERA BREAD CL,A	101	19 639 €	0,000
PARK HOTEL RESORTS	-1275	36 144 €	0,000
PARKER-HANNIFIN	7562	1 003 726 €	0,006
PARMALAT	688924	2 040 593 €	0,037
PARROT PROMESSES	68000	705 840 €	0,226
PARTNERS GROUP NOM	1552	690 944 €	0,006
PATTERSON CIES	15070	586 226 €	0,015
PATTERSON-UTI	12964	330 875 €	0,009
PAYCHEX	26457	1 527 094 €	0,007
PAYPAM HOLDING INC	467178	17 482 357 €	0,039
PAYSAFE GROUP PLC	505853	2 200 366 €	0,103
PBF ENERGY SER A	193400	5 112 104 €	0,177
PCCW	3473440	1 783 941 €	0,045
PDL BIOPHARMA	37058	74 485 €	0,022
PEARSON	84592	811 136 €	0,010
PEMBINA PPLN INC TR	29387	871 772 €	0,008
PENAUILLÉ POLYSCES	64335	270 271 €	0,039
PENNEY (J,C,)	9818	77 353 €	0,003
PENNYMAC MORTGAGE	15534	241 092 €	0,023
PENTAIR PLC	11099	590 017 €	0,006
PEOPLES UNITED	62390	1 145 172 €	0,020
PEPSICO	22350	2 217 095 €	0,002
PERKINELMER	2428	120 048 €	0,002
PERNOD-RICARD	264723	27 253 233 €	0,100
PERPETUAL	3863	129 315 €	0,008
PERRIGO COMPANY	11637	918 272 €	0,008
PERSIMMON	82737	1 721 426 €	0,027
PETRA DIAMONDS	1141709	2 095 897 €	0,215
PETROFAC	135597	1 380 433 €	0,039
PEUGEOT	2059180	31 906 994 €	0,254
PFIZER	841477	25 912 465 €	0,014
PG AND E	96844	5 579 720 €	0,019
PHILIP MORRIS	320616	27 810 531 €	0,021
PHILLIPS 66	275733	22 589 323 €	0,053
PIEDMONT OFFICE REAL	1285	25 475 €	0,001
PIERRE VACANCES	26600	1 008 938 €	0,271
PINGUELY HAULOTTE	103718	1 458 275 €	0,331
PINNACLE WEST	4942	365 607 €	0,004
PIONEER NAT,RES	36910	6 301 383 €	0,022
PITNEY BOWES ORD	21534	310 122 €	0,012

PLANT IMPACT	1057187	591 386 €	1,294
PLASTIC OMNIUM	542105	16 442 045 €	0,356
PLATINUM AM	46352	168 020 €	0,008
PLAYTECH	422469	4 088 090 €	0,133
PNC FIN,SCES GROUP	188271	20 877 152 €	0,039
POLARIS INDUSTRIE	7115	555 776 €	0,011
POLYONE	9785	297 238 €	0,012
PORR AG	76896	2 992 792 €	0,264
PORSHE AUTOMOBILE	390576	20 208 402 €	0,255
POSTE ITALIANE	115229	726 519 €	0,018
POSTNL NV	257487	1 053 637 €	0,058
POWER CORP,CANADA	36803	781 880 €	0,009
POWER FINANCIAL	32300	766 367 €	0,005
PRADA	335125	1 077 790 €	0,013
PRAXAIR	44130	4 903 147 €	0,015
PREMIER OIL	1848684	1 602 655 €	0,362
PRICE T ROWE GROUP	19472	1 389 393 €	0,008
PRICELINE,COM	21855	30 377 569 €	0,044
PRIMA MEAT PACKERS	1031000	3 486 370 €	0,408
PRINCIPAL FCIAL	14277	783 188 €	0,005
PROASSURANCE	623	33 195 €	0,001
PROCTER GAMBLE	263860	21 033 751 €	0,010
PROGRESSIVE	49557	1 667 953 €	0,009
PROLOGIS	39841	1 994 033 €	0,008
PROSEGUR	650000	3 861 000 €	0,105
PROSIEBEN NOM,	131181	4 802 536 €	0,056
PROSPERITY BANC SHS	775	52 742 €	0,001
PROTO	56000	609 978 €	0,277
PROVIDENT FINANCI	45004	1 502 067 €	0,030
PRUDENTIAL	243723	4 646 898 €	0,009
PRUDENTIAL FCIAL	27394	2 702 650 €	0,006
PRYSMIAN	99842	2 436 145 €	0,046
PUBLIC SCE ENT	22338	929 312 €	0,004
PUBLIC STORAGE	10305	2 183 615 €	0,006
PUBLICIS GROUPE	376769	24 697 208 €	0,167
PULTE HOMES	96929	1 689 078 €	0,029
PVH	8081	691 377 €	0,010
QANTAS AIRWAYS	33294	76 115 €	0,002
QBE INS,GROUP	360732	3 075 856 €	0,026
QIAGEN	224028	5 977 067 €	0,096
QORVO INC	2175	108 735 €	0,002
QUALCOMM	305152	18 863 153 €	0,021
QUALITY CARE INC	7041	103 470 €	0,008
QUANTA SERVICES	6792	224 415 €	0,005
QUANTUM PHARMA	2316974	1 167 173 €	1,370
QUEBECOR SUB VTG B	4137	109 154 €	0,005
QUEST DIAGNOSTICS	17883	1 558 140 €	0,013
QUINTILES TRANSNTL	19891	1 434 189 €	0,008
RAIFFEIS,INTL BK	207794	3 611 460 €	0,071
RAITO KOGYO	85000	829 128 €	0,147
RAKUTEN	268700	2 501 982 €	0,019
RALPH LAUREN A	6939	594 198 €	0,012
RAMSAY HEALTH CARE	54979	2 577 966 €	0,027
RANDGOLD RESOURCES	16153	1 213 935 €	0,017
RANDSTAD PROV,DIV	89860	4 630 486 €	0,049
RATHBONE BROTHERS	65542	1 522 608 €	0,129
RATIONAL	20935	8 876 440 €	0,184
RAYMOND JAMES FIN,	4600	302 102 €	0,003
RAYSEARCH LABS B	400000	7 701 941 €	1,563
REAL GOLD MINING LTD	90500	- €	0,010
REALESTATE,COM,AU	33789	1 281 180 €	0,026
REALTY INCOME	18239	993 958 €	0,007
RECKITT BENCKISER	84742	6 836 146 €	0,012
RECORDATI IND,CHI	362064	9 746 763 €	0,173
RECRUIT HOLDINGS	115700	4 410 905 €	0,020
RED ELECTRICA CORPOR	983435	17 628 072 €	0,182

RED HAT	85539	5 652 589 €	0,046
REED ELSEVIER	125866	2 136 596 €	0,012
REGAL BELOIT	329	21 601 €	0,001
REGAL ENTERT,CL,A	8014	156 519 €	0,006
REGENCY CENTERS	18205	1 190 078 €	0,017
REGENERON PHARM	21782	7 580 900 €	0,021
REGENERSIS	676462	1 850 444 €	1,163
REGIONS FINANCIAL	1167060	15 889 056 €	0,095
REINSU GRP AMERICA	3544	422 794 €	0,006
RELIANCE STEEL ALU	8753	660 075 €	0,012
RELO HOLDINGS	17000	2 302 212 €	0,111
RELX N,V,	737531	11 793 121 €	0,072
REMY COINTREAU	132804	10 759 780 €	0,267
RENAISSANCE RE HLD	12095	1 562 058 €	0,029
RENAULT	222732	18 823 081 €	0,075
RENISHAW PLC	340886	10 095 593 €	0,468
REPSOL DO 16	1875452	660 159 €	0,000
REPSOL YPF	1875495	25 169 143 €	0,125
RESMED	15126	889 849 €	0,001
RESONA HOLDINGS	624500	3 043 288 €	0,027
RESORTTRUST	90800	1 592 791 €	0,084
RESTAURANT BRANDS	18401	831 945 €	0,008
RESTAURANT GROUP	500000	1 900 773 €	0,249
REXEL PROMESSES	900615	14 081 116 €	0,297
REYNOLDS AMERICAN	136700	7 263 018 €	0,010
REZIDOR HOTEL	898977	3 330 587 €	0,516
RHEINMETALL ORD,	1552	99 173 €	0,004
RIB SOFTWARE	96342	1 199 940 €	0,206
RIGHTMOVE	261156	11 941 095 €	0,280
RINNAI	13500	1 034 825 €	0,026
RIO TINTO	13441	552 736 €	0,003
RIO TINTO PLC	168538	6 145 505 €	0,012
RIOCAN REAL UNIT	36492	687 039 €	0,011
RITE AID	20740	162 027 €	0,002
RLI	377	22 565 €	0,001
RLJ LODGING TR SBI	13648	316 890 €	0,011
RM2 INTERNATIONAL	2577337	966 199 €	0,644
RNTS MEDIA	462304	952 809 €	0,404
ROBERT HALF INTL	16146	746 719 €	0,013
ROBERTET	8000	2 800 000 €	0,371
ROCHE HOLDING BJ	79823	17 319 804 €	0,011
ROCKWELL AUTOMAT	11166	1 422 811 €	0,009
ROCKWELL COLLINS	46129	4 056 815 €	0,035
ROGERS CIONS CL,B	54903	2 010 270 €	0,014
ROHM	54700	2 992 429 €	0,049
ROLLS ROYCE HOLDIN	174180	1 363 077 €	0,009
ROLLS-ROYCE HLD NV	8012280	9 386 €	0,000
ROPER INDUSTRIES	27405	4 756 869 €	0,027
ROSS STORES	142156	8 841 369 €	0,036
ROTORK PLC	1915761	5 413 327 €	0,220
ROYAL BANK CANADA	69169	4 443 697 €	0,005
ROYAL BK SCOT, GRP	424878	1 117 943 €	0,004
ROYAL CARIBBEAN	3050	237 233 €	0,001
ROYAL DUTCH SHELL	383 065	10 063 534 €	0,005
ROYAL DUTCH SHELL	392 234	10 816 762 €	0,005
ROYAL MAIL PLC	169977	920 178 €	0,017
RPM INTL INC	23914	1 220 470 €	0,018
RPS GROUP PLC	650000	1 694 295 €	0,291
RSA INSURANC GRP PLC	74155	509 077 €	0,007
RTL GROUP	101672	7 099 044 €	0,066
RUBIS	152590	11 952 375 €	0,336
RWE PF	596676	5 202 418 €	0,097
RYDER SYSTEM	9087	641 324 €	0,017
RYMAN HEALTHCARE G	44317	237 603 €	0,009
RYOBI	325000	1 212 600 €	0,190
RYOHIN KEIKAKU	13900	2 588 579 €	0,050

SA SA INTERNATIONAL	945534	356 122 €	0,032
SABRE	3280	77 588 €	0,001
SAFESTORE HOLDING	844830	3 464 041 €	0,405
SAFEWAY PDC LLC CVR	60 198	57 924 €	0,000
SAFEWAY PDC LLC CVR	60 198	2 785 €	0,000
SAFRAN	351365	24 040 393 €	0,084
SAGE GROUP PLC	122843	942 621 €	0,011
SAINSBURY	278632	813 765 €	0,013
SAINT MARC HOLDINGS	66600	1 924 577 €	0,292
SAINT-GOBAIN	382339	16 920 412 €	0,069
SAIPEM	7381266	3 948 977 €	0,073
SAKATA INKS	21500	252 713 €	0,034
SALESFORCE,COM	189728	12 314 557 €	0,027
SALVATORE FERRAGAM	173477	3 891 089 €	0,103
SALZGITTER	8726	292 757 €	0,015
SAMPO A	262955	11 199 253 €	0,047
SAMSONITE INTL SA	331690	898 416 €	0,024
SAN A	20200	929 371 €	0,063
SAN,AV,ADR SPONS	54620	2 094 177 €	0,004
SANDS CHINA	438971	1 808 994 €	0,005
SANDVIK	203047	2 388 165 €	0,016
SANKYU	655000	3 764 282 €	0,201
SANOFI AVENTIS	1531897	117 802 879 €	0,119
SANTANDER CONSUMER	10000	127 992 €	0,003
SANTOS	336475	928 621 €	0,017
SANYO CHEMICAL IND	23000	934 801 €	0,098
SANYO DENKI	75000	498 087 €	0,116
SAP SYSTEME ORD	301161	24 939 142 €	0,025
SARTORIUS PRIV	144132	10 161 306 €	0,385
SARTORIUS STEDIM BIO	370108	22 195 377 €	0,402
SATO HOLDINGS	38600	734 531 €	0,111
SAVANNAH PETROLEUM	3352716	1 060 489 €	1,221
SBA COMMUNICATIONS	9638	943 560 €	0,008
SBI	203500	2 459 783 €	0,091
SBM OFFSHORE	33487	499 459 €	0,016
SBS HOLDINGS	100000	662 490 €	0,252
SCANA	7730	537 051 €	0,005
SCANDINAV TOBACCO	217652	3 480 418 €	0,218
SCENTRE GROUP	71655	228 257 €	0,003
SCHAEFFLER PREF	36722	516 128 €	0,022
SCHEIN HENRY	5474	787 353 €	0,007
SCHIBSTED CLASS A	47408	1 034 423 €	0,021
SCHIBSTED CLASS B	46728	941 868 €	0,021
SCHINDLER HOLD,BP	6454	1 081 286 €	0,006
SCHINDLER HOLD,NOM	2787	462 507 €	0,003
SCHLUMBERGER ORD	171907	13 682 477 €	0,012
SCHNEIDER ELECTRIC	624654	41 295 876 €	0,106
SCHOELLER BLECKM	27878	2 133 503 €	0,174
SCHROEDERS	61105	2 146 120 €	0,022
SCHWAB CHARLES	321729	12 039 482 €	0,024
SCIENCE APPLICAT	1947	156 535 €	0,004
SCOR REGPT	453276	14 881 051 €	0,236
SCOTT,SOUTH,ENERGY	132466	2 410 025 €	0,013
SCRIPPS NETWORKS	16624	1 124 868 €	0,017
SEAGATE TECHNOLOGIE	14441	522 601 €	0,005
SEALED AIR	51355	2 207 571 €	0,027
SEATTLE GENETICS	2340	117 072 €	0,002
SEAWORLD ENTMT	5260	94 403 €	0,006
SEB	214465	27 612 369 €	0,427
SECURITAS S,B	30833	461 433 €	0,009
SEEK	118714	1 212 731 €	0,034
SEI INVESTMENTS	9127	427 124 €	0,006
SEIBU HOLDINGS INC	184100	3 136 653 €	0,054
SEKISUI CHEMICAL	51500	780 323 €	0,010
SEKISUI HOUSE	114700	1 813 912 €	0,016
SEMBCORP MARINE	54197	49 082 €	0,003

SEMICONDUCTOR MANUF	291800	434 614 €	0,003
SEMPRA ENERGY	16907	1 613 198 €	0,007
SENIOR HOUSING	3838	68 882 €	0,002
SENSATA TECHNOLOGI	17707	653 887 €	0,010
SENSIENT TECHN,	4277	318 641 €	0,010
SERGE FERRARI GROUP	21873	254 820 €	0,178
SERVICE CORP,INTL	4776	128 598 €	0,003
SERVICENOW	163403	11 516 832 €	0,098
SES GLOBAL FDR	603131	12 620 516 €	0,157
SEVEN AND I HOLD	16000	579 154 €	0,002
SEVEN WEST MEDIA	350260	193 574 €	0,023
SEVERN TRENT	35687	928 966 €	0,015
SFR GROUP	347758	9 330 347 €	0,079
SGS NOM,	795	1 536 604 €	0,010
SHAFTESBURY	782818	8 336 241 €	0,281
SHANGRI LA ASIA	92269	92 296 €	0,003
SHAW CIONS CL,B	69398	1 321 773 €	0,015
SHERWIN-WILLIAMS	22087	5 627 552 €	0,024
SHIKOKU CHEMICALS	244000	2 106 376 €	0,404
SHIMA SEIKI MFG	10100	324 705 €	0,024
SHIMACHU	51200	1 296 431 €	0,100
SHIMANO	2000	298 161 €	0,002
SHIN-ETSU CHEMICAL	99700	7 348 187 €	0,023
SHINMAYWA IND	130000	1 110 625 €	0,130
SHINSEI BANK	1084000	1 727 058 €	0,039
SHIONOGI	53800	2 448 579 €	0,015
SHIRE	83313	4 571 674 €	0,007
SHIRE ADR	2217	358 125 €	0,001
SHIZUOKA GAS	109800	736 339 €	0,144
SHOP APOTHEKE EUR	90684	2 368 213 €	1,000
SHOWA DENKO KK	90000	1 224 671 €	0,060
SHUI ON LAND	2653579	541 901 €	0,033
SHUN TAK HOLDINGS	350474	114 858 €	0,012
SIA ENGINEERING	63130	139 617 €	0,006
SIEMENS	343175	40 082 840 €	0,040
SIGNATURE BANK	1699	241 943 €	0,003
SIGNET JEWELERS LTD	9295	830 668 €	0,013
SIIX	91200	2 924 579 €	0,362
SIKA POR,	2437	11 121 086 €	0,113
SILVER WHEATON	84272	1 545 488 €	0,019
SIMCORP	290131	13 430 491 €	0,699
SIMON PROPERTY GRP	15266	2 571 520 €	0,005
SIMS	128537	1 132 177 €	0,065
SINGAPORE AIRLINES	54500	345 856 €	0,005
SINGAPORE AIRPORT	480400	1 529 033 €	0,043
SINGAPORE EXCHANGE	169217	795 113 €	0,016
SINGAPORE POST	1071520	1 030 172 €	0,050
SINGAPORE PRESS	1091554	2 528 669 €	0,068
SINGAPORE TECHN	542100	1 149 090 €	0,017
SINGAPORE TELECOM	1791711	4 291 735 €	0,006
SINO LAND	667605	948 631 €	0,011
SINTOKOGIO	77300	639 031 €	0,142
SIRIUS XM HOLDINGS	403608	1 702 826 €	0,008
SJM HLDGS LTD	1121744	834 005 €	0,020
SK KAKEN	18000	1 521 694 €	0,115
SKANDINAV,ENSK,A	151459	1 510 322 €	0,007
SKANSKA S,B	46350	1 040 481 €	0,012
SKY CITY ENTERT	125494	326 045 €	0,019
SKY NETWORK TV	73700	221 687 €	0,019
SKYWORKS SOLUTIONS	5340	377 989 €	0,003
SL GREEN REALTY	5072	517 178 €	0,005
SLM	14297	149 375 €	0,003
SM ENERGY	2053	67 113 €	0,002
SMART REIT	2843	64 902 €	0,002
SMC	25600	5 806 888 €	0,038
SMITH NEPHEW	448931	6 421 565 €	0,051

SMITH(DS)	193500	925 110 €	0,020
SMITHS GROUP	58776	975 010 €	0,015
SMUCKER	8113	985 021 €	0,007
SNAM RETE GAS	2246685	8 793 525 €	0,064
SNAP ON	3508	569 628 €	0,006
SNC LAVALIN	25228	1 030 737 €	0,017
SOCIETE GENERALE A	1327413	62 049 921 €	0,164
SOCIETE LDC	16000	1 511 840 €	0,096
SODEXHO ALLIANCE	207200	22 626 240 €	0,135
SODEXO PF 2020	10000	1 092 000 €	0,007
SODEXO PRI FID 2019	41800	4 564 560 €	0,027
SOFINA	21466	2 690 763 €	0,063
SOFTBANK	196200	12 384 028 €	0,018
SOLUTIONS 30	49299	672 438 €	0,241
SOLVAY	11500	1 280 525 €	0,011
SOMFY	10868	4 212 437 €	0,147
SONIC HEALTHCARE	189799	2 788 479 €	0,046
SONOCO PRODUCTS	2305	115 168 €	0,002
SONOVA HOLDING NOM	7235	832 835 €	0,011
SOPHOS GROUP	1086096	3 328 523 €	0,235
SOPRA GROUP	157910	17 030 594 €	0,771
SOUTH 32 LTD	20806	39 281 €	0,000
SOUTHERN COPPER	19006	575 541 €	0,002
SOUTHWEST AIRLINES	324224	15 320 525 €	0,053
SOUTHWEST GAS	8780	637 804 €	0,018
SPECTRIS	40000	1 083 880 €	0,034
SPECTRUM BRDS HLDG	1547	179 421 €	0,003
SPIE	434405	8 694 616 €	0,282
SPIRAX-SARCO ENG PLC	30647	1 502 191 €	0,042
SPIRE	20589	1 260 033 €	0,045
SPIRIT AEROSYSTEMS	5736	317 322 €	0,005
SPLUNK INC	122762	5 953 331 €	0,090
SPRINT NEXTEL CORP	61135	488 037 €	0,002
SRA HOLDINGS	5500	114 810 €	0,036
SRP GROUP	172691	3 681 772 €	0,525
ST JUDE MEDICAL	23067	1 753 726 €	0,008
ST TELEMEDIA ORD	181763	851 039 €	0,021
ST, JAMES S PLACE	1063111	12 628 802 €	0,202
STABILUS GMBH	71961	3 672 889 €	0,291
STAGECOACH GROUP NV	1154096	2 923 097 €	0,201
STANDARD CHARTERED	306025	2 379 079 €	0,009
STANDARD LIFE BK PLC	216884	945 183 €	0,011
STANLEY BLACK DECKER	111852	12 162 414 €	0,074
STAPLES	98009	840 940 €	0,015
STARBUCKS	184396	9 706 249 €	0,013
STARHUB	927028	1 709 508 €	0,054
STARTS	245300	3 944 076 €	0,454
STATE STREET	330085	24 322 547 €	0,086
STATOILHYDRO	259613	4 529 430 €	0,008
STEEL DYNAMICS	47170	1 591 191 €	0,019
STEF TFE	49263	3 932 665 €	0,374
STERICYCLE	17490	1 277 487 €	0,021
STMICROELECTRONICS	2036058	21 938 525 €	0,224
STOCKLAND	1014903	3 191 168 €	0,042
STONE ENERGY	1958	13 273 €	0,034
STORA ENSO S,R	1603877	16 375 584 €	0,262
STORE EL,SYS,PROM	102389	2 791 124 €	0,856
STRATEC BIOMEDICAL	130571	5 978 193 €	1,101
STRAUMANN HOLDING	8536	3 165 168 €	0,054
STRYKER	66165	7 515 742 €	0,018
SUDZUCKER	294820	6 689 466 €	0,144
SUEZ ENVIRON,COMP	1028742	14 417 819 €	0,182
SUMITOMO	222100	2 483 308 €	0,018
SUMITOMO ELECTRIC	245500	3 365 575 €	0,031
SUMITOMO FORESTRY	221400	2 785 929 €	0,125
SUMITOMO METAL	103000	1 261 746 €	0,018

SUMITOMO MITSUI	552200	20 019 476 €	0,039
SUMITOMO OSAKA	200000	716 952 €	0,048
SUMITOMO SEIKA	22500	838 578 €	0,161
SUMITOMO WAREHOUSE	150000	753 531 €	0,077
SUMMIT INTERNAT	1149116	- €	0,014
SUN ART RETAIL GRO	1100500	915 104 €	0,012
SUN FRONT,FUDOSAN	130000	1 088 434 €	0,304
SUN HUNG KAI PROP	304300	3 646 696 €	0,011
SUN LIFE FINANCIAL	49052	1 787 713 €	0,008
SUNCORP GROUP	331443	3 076 417 €	0,026
SUNTEC REAL ESTATE	953114	1 032 050 €	0,037
SUNTRUST BANKS	33609	1 747 764 €	0,007
SUPERIOR ENER,SCES	1951	31 223 €	0,001
SURUGA BANK	354100	7 509 680 €	0,153
SUZUKI MOTOR	115000	3 845 772 €	0,023
SVENSKA HANDEL FONDE	146592	1 936 814 €	0,008
SWATCH GROUP NOM	2247	130 481 €	0,001
SWATCH GROUP POR	4235	1 251 142 €	0,003
SWECO B	226716	4 263 643 €	0,205
SWEDBANK A	83969	1 930 533 €	0,007
SWEDISH MATCH	38947	1 177 921 €	0,021
SWIRE PROPERTIES	443424	1 160 391 €	0,008
SWISS LIFE HO,NOM,	3971	1 067 577 €	0,012
SWISS PRIME SITE	15885	1 235 088 €	0,026
SWISS RE	35203	3 168 927 €	0,010
SWISSCOM NOM	4633	1 971 186 €	0,009
SWORD GROUP	105464	3 062 675 €	1,117
SYDNEY AIRPORT UNITS	609576	2 506 769 €	0,027
SYMANTEC	53665	1 215 508 €	0,009
SYMRISE	248900	14 393 887 €	0,192
SYNCHRONY FCIAL	115737	3 979 882 €	0,014
SYNERGIE	147698	5 169 430 €	0,606
SYNGENTA NOM	8991	3 375 819 €	0,010
SYNOPSIS	16861	940 923 €	0,011
SYSCO	50123	2 631 250 €	0,009
SYSMEX	45200	2 487 417 €	0,022
T AND D	341600	4 291 492 €	0,050
T&K TOKA	174600	1 451 915 €	0,698
TABCORP HOLDINGS	467220	1 542 859 €	0,056
TADANO	65000	777 755 €	0,050
TAIHEIYO CEMENT	750000	2 255 716 €	0,059
TAKAMATSU	55100	1 113 459 €	0,142
TAKARA LEBEN	175000	968 739 €	0,139
TAKEAWAY,COM B,V	109013	2 561 806 €	0,252
TAKKT	486845	10 472 036 €	0,742
TAKUMA	80000	649 646 €	0,096
TALANX AG	136761	4 344 897 €	0,054
TARGET	204935	14 034 089 €	0,036
TARKETT SA	546067	18 615 424 €	0,857
TATTS GROUP	682179	2 098 148 €	0,046
TAUBMAN CENTERS	721	50 537 €	0,001
TAYLOR WIMPEY	378480	680 608 €	0,012
TD AMERITRADE HLDG	166055	6 864 184 €	0,032
TDC	115576	563 615 €	0,014
TDK	101500	6 633 512 €	0,078
TE CONNECTIVITY LTD	67382	4 425 907 €	0,019
TECAN GROUP NOM	31723	4 702 225 €	0,275
TECH DATA	2603	208 980 €	0,007
TECHNICOLOR	885701	4 552 503 €	0,215
TECHNIP	310941	21 084 909 €	0,261
TECHTRONIC INDUST	634422	2 156 724 €	0,035
TED BAKER	76938	2 536 358 €	0,175
TEGNA	17579	356 497 €	0,008
TEIJIN	55000	1 059 130 €	0,028
TEL,ERICSSON S,B	334531	1 867 816 €	0,011
TELE COLUMBUS	521974	4 123 595 €	0,409

TELE2 AB-B	68407	521 512 €	0,014
TELECOM ITAL,EPAR	9862856	6 775 782 €	0,065
TELECOM ITAL,ORD	10478489	8 770 495 €	0,069
TELECOM NEW ZEALD	681832	1 537 069 €	0,037
TELEDYNE TECHN	2685	313 112 €	0,008
TELEFLEX	1396	213 288 €	0,003
TELEFONICA	2880772	25 408 409 €	0,057
TELEFONICA DEUTSCH	1674762	6 816 281 €	0,056
TELEKOM AUSTRIA	527705	2 960 425 €	0,079
TELENET GROUP HOLD	185217	9 764 640 €	0,158
TELEPERFORMANCE	386081	36 793 519 €	0,668
TELEPH DATA SYST NV	11959	327 335 €	0,012
TELEPIZZA GROUP	896688	4 048 546 €	0,890
TELIASONERA	354321	1 357 454 €	0,008
TELSTRA	1152331	4 034 662 €	0,010
TELUS CORP	57703	1 744 002 €	0,010
TEMENOS GROUP NOM	62979	4 165 309 €	0,091
TENARIS	331535	5 626 149 €	0,028
TERADATA	7237	186 423 €	0,006
TERADYNE	1328	31 980 €	0,001
TERNA	1431320	6 229 105 €	0,071
TESCO	804145	1 948 657 €	0,010
TESLA MOTORS	47188	9 560 184 €	0,029
TESORO	25155	2 085 617 €	0,022
TESSI	19831	3 192 791 €	0,709
TEXAS INSTRUMENTS	126596	8 758 199 €	0,013
TEXWINCA HOLD,DIV	712408	441 681 €	0,052
TF1	522641	4 939 480 €	0,250
TGS-NOPEC GEOPHYS	125000	2 639 333 €	0,122
THALES	400847	36 930 034 €	0,189
THE KRAFT HEINZ COMP	3998	330 984 €	0,000
THE LINK REIT	535369	3 299 554 €	0,024
THE MOSAIC	8924	248 154 €	0,003
THERMO FISHER	40784	5 455 911 €	0,010
THOMSON REUTERS	39519	1 641 724 €	0,005
THULE GROUP AB	231610	3 444 419 €	0,229
THYSSENKRUPP	201192	4 554 987 €	0,036
TIFFANY	10588	777 273 €	0,009
TIME INC	4046	68 472 €	0,004
TIME WARNER	88593	8 107 971 €	0,011
TINGYI HOLDING	587833	677 856 €	0,010
TITAN PETROCHEMICALS	780000	7 344 €	0,002
TJX COS	213697	15 221 669 €	0,033
T-MOBILE US	125519	6 843 894 €	0,015
TOKAI CORP	32900	1 065 726 €	0,183
TOKAI TOKYO SECU	428300	2 165 509 €	0,153
TOKIO MARINE HOLD	131400	5 122 665 €	0,017
TOKYO STEEL MFG	422900	3 083 554 €	0,273
TOLL BROTHERS	12031	353 601 €	0,007
TOMOKU	334000	890 516 €	0,345
TOMRA SYSTEMS	85700	854 263 €	0,058
TOPCON	160600	2 300 239 €	0,149
TOPRE	171500	4 079 058 €	0,317
TORCHMARK	14618	1 022 255 €	0,012
TORONTO DOMIN BANK	89579	4 193 801 €	0,005
TOSEI	100000	711 262 €	0,207
TOSOH	275000	1 848 671 €	0,042
TOTAL FINA	2387358	116 312 082 €	0,099
TOTAL SYSTEM SERV	16371	761 005 €	0,009
TOURMALINE OIL	7660	194 472 €	0,003
TOWNGAS CHINA	2058000	1 026 779 €	0,076
TOYO BUSSAN	16900	148 365 €	0,084
TOYO TIRE RUBBER	80000	946 181 €	0,063
TOYOTA INDUSTRIES	107400	4 862 739 €	0,033
TOYOTA MOTOR	83300	4 657 240 €	0,003
TPR CO LTD	82900	2 217 032 €	0,230

TRACTOR SUPPLY	80994	5 821 432 €	0,064
TRANSDIGM GROUP INC	6090	1 437 465 €	0,011
TRANSOCEAN LTD	27261	380 969 €	0,007
TRANSURBAN UNIT	632294	4 479 798 €	0,031
TRAVEL SP ADS-A	48552	540 873 €	0,162
TRAVELERS COS	19180	2 226 135 €	0,007
TRAVIS PERKINS	38018	646 698 €	0,015
TREASURY WINE EST	280966	2 060 083 €	0,038
TREEHOUSE FOODS	2790	190 955 €	0,005
TREND MICRO	54700	1 847 480 €	0,039
TRIGANO	42458	3 155 903 €	0,220
TRIMBLE NAVIGATION	25329	724 029 €	0,010
TRIPADVISOR	5647	248 259 €	0,004
TRITAX BIG BOX REI	1496876	2 446 277 €	0,135
TRIUMPH GROUP	2418	60 751 €	0,005
TRYGVESTA A/S NV	132005	2 267 087 €	0,047
TS TECH	22500	550 517 €	0,033
TSUBAKI NAKASHIMA	54900	759 545 €	0,137
TSUBAKIMOTO CHAIN	30000	231 668 €	0,016
TSUKADA GLOBAL HOL	147400	815 955 €	0,301
TULLOW OIL	436993	1 600 840 €	0,048
TURQUOISE HILL	98303	299 541 €	0,005
TV BROADCASTS	235859	735 469 €	0,054
TWENTY FST CENTUR B	48976	1 265 320 €	0,006
TWITTER	40943	632 729 €	0,006
TYCO INTL	297016	11 599 042 €	0,022
TYMAN	891979	2 878 869 €	0,501
TYSON FOODS CL,A	6373	372 682 €	0,002
U S BANCORP	364280	17 741 705 €	0,021
UACJ CORPORATION	225000	587 096 €	0,053
UBE INDUSTRIES	350000	697 037 €	0,033
UBI BANCA	1618006	4 226 232 €	0,166
UBI SOFT ENTERTAIN	140137	4 736 631 €	0,123
U-BLOX HOLDING	37000	6 599 254 €	0,542
UBM REALITAETEN AG	25850	801 350 €	0,346
UBS NOM	354611	5 276 162 €	0,009
UCB	187795	11 438 593 €	0,097
UDR	26302	909 691 €	0,010
UGI	36950	1 614 274 €	0,021
ULTA SALON COS&FRA	33450	8 085 085 €	0,054
ULTIMATE SOFTWARE	20187	3 490 021 €	0,070
ULVAC	20000	582 015 €	0,041
UMICORE	358585	19 417 378 €	0,320
UNDER ARMOUR CL A	43212	1 190 148 €	0,011
UNDER ARMOUR INC	27339	652 404 €	0,007
UNI CHARM	54300	1 128 852 €	0,009
UNIBAIL	118311	26 827 019 €	0,119
UNICREDIT	6355252	17 375 259 €	0,103
UNILEVER	127 520	4 918 693 €	0,010
UNILEVER	523 945	20 494 109 €	0,010
UNION PACIFIC ORD	77811	7 648 679 €	0,009
UNIPER SE	181470	2 379 979 €	0,050
UNIPOL	475400	1 627 770 €	0,066
UNITED COMPANY RUS	489000	196 135 €	0,003
UNITED CONTINENTAL	23184	1 601 944 €	0,007
UNITED DRUG	350574	2 745 533 €	0,142
UNITED OVS BK LCL	252755	3 383 779 €	0,015
UNITED PARCEL CL,B	131329	14 274 052 €	0,019
UNITED RENTALS	8304	831 227 €	0,010
UNITED TECHNO,	172623	17 940 681 €	0,021
UNITED THERAPEUTIC	1000	135 985 €	0,002
UNITED UTILITIES	163448	1 725 242 €	0,024
UNITEDHEALTH GROUP	141574	21 481 397 €	0,015
UNIV,HEAL,SCE CL,B	9579	966 119 €	0,011
UNIVERSAL	4886	295 314 €	0,021
UNUM GROUP	17308	720 873 €	0,007

UOL GROUP	332034	1 305 213 €	0,041
UPM KYMMENE	968050	22 594 287 €	0,181
URBAN OUTFITTERS I	1158	31 268 €	0,001
UTD INTERNET NOM	146169	5 422 139 €	0,071
VALEANT PHARM INTL	7095	97 663 €	0,002
VALEO	426892	23 312 572 €	0,179
VALERO ENERGY	38171	2 472 475 €	0,008
VALIDUS HOLDINGS LTD	1756	91 583 €	0,002
VALLEY NAT,BANCORP	7172	79 149 €	0,003
VALLOUREC	535602	3 508 193 €	0,119
VALSPAR	18448	1 812 180 €	0,023
VANTIV A CLASS A	93930	5 309 416 €	0,058
VARIAN MEDICAL SYS	10280	875 030 €	0,011
VCA ANTECH	18710	1 217 769 €	0,023
VENTAS	18382	1 089 588 €	0,005
VENTURE CORP	186379	1 208 442 €	0,067
VEOLIA ENVIRON	385580	6 236 757 €	0,068
VEREIT	114535	918 669 €	0,012
VERISIGN	35561	2 564 708 €	0,034
VERISK ANALYTICS A	20568	1 582 844 €	0,012
VERIZON CIONS	692151	35 029 173 €	0,017
VERMILION ENERGY	40740	1 627 065 €	0,035
VERTEX PHARM	105330	7 356 872 €	0,042
VESTAS WIND SYST	44887	2 770 896 €	0,020
VETO PROMESSES	43000	1 957 790 €	0,362
VF	26377	1 334 167 €	0,006
VIACOM CL,B	20304	675 677 €	0,005
VICAT	78787	4 542 858 €	0,175
VICTREX PLC	304589	6 890 363 €	0,356
VIENNA INSUR,GROUP	144727	3 082 685 €	0,113
VILMORIN CLAUSE	22698	1 358 021 €	0,109
VINCI	666767	43 139 825 €	0,112
VIRBAC	51600	8 627 520 €	0,610
VIRGIN HOLDINGS NV	441960	- €	0,000
VISA INC LTD	475318	35 159 337 €	0,026
VISCOFAN	129325	6 058 876 €	0,277
VITROLIFE	45000	1 817 470 €	0,207
VIVENDI UNIVERSAL	1612006	29 104 768 €	0,125
VMWARE A	11612	866 758 €	0,002
VOCUS COMMUNICATIO	249382	662 576 €	0,040
VODAFONE GROUP	2574300	6 027 107 €	0,008
VOESTALPINE	97723	3 644 091 €	0,056
VOLKSWAGEN ORD	59790	8 176 283 €	0,012
VOLKSWAGEN PF	255961	34 132 399 €	0,051
VOLVO S,B	168900	1 875 492 €	0,010
VONOVIA	265774	8 213 745 €	0,057
VORNADO REALTY	5377	532 067 €	0,003
Voya Financial INC	20131	748 554 €	0,010
VTECH HOLDINGS	154853	1 963 676 €	0,062
VULCAN MATERIALS	73177	8 682 722 €	0,055
VZ HOLDING	26994	7 692 786 €	0,337
WABCO HOLDINGS	10096	1 016 061 €	0,018
WABTEC	6640	522 638 €	0,007
WACKER CHEMIE	16096	1 591 090 €	0,031
WAL MART STORES	315145	20 652 119 €	0,010
WALGREEN	57287	4 494 972 €	0,005
WALLIX GROUP	37163	299 534 €	0,930
WANT WANT CHINA	1548465	941 086 €	0,012
WAREHOUSE GROUP	195349	368 059 €	0,056
WARTSILA	171536	7 321 156 €	0,087
WASH TEC	55533	2 765 321 €	0,397
WASHINGTON FEDERAL	1946	63 375 €	0,002
WASTE CONNECTIONS	53080	3 955 020 €	0,030
WASTE MANAGEMENT	15900	1 068 944 €	0,004
WATERS	13449	1 713 592 €	0,017
WATSCO	1301	182 701 €	0,004

WEATHERFORD INTL	109847	519 684 €	0,011
WEBSTER FINANCIAL	1093	56 248 €	0,001
WEC ENERGY GROUP	246400	13 701 218 €	0,078
WEINGARTEN RTY IN	14967	507 863 €	0,012
WELLPOINT	45811	6 244 368 €	0,017
WELLS FARGO	507777	26 531 017 €	0,010
WELLTOWER INC	39521	2 507 836 €	0,011
WENDEL INVEST	114149	13 058 646 €	0,242
WENDY'S CO/THE	3239	41 518 €	0,001
WERELDHAVE	22000	940 720 €	0,055
WESCO INTL	4839	305 319 €	0,010
WESFARMERS	211358	6 114 668 €	0,019
WEST FRASER TIMBER	2500	84 856 €	0,003
WEST JAPAN RAILWAY	25000	1 457 680 €	0,013
WESTERN DIGITAL	8914	574 265 €	0,003
WESTERN UNION	29410	605 627 €	0,006
WESTFIELD CORP	87	560 €	0,000
WESTPAC BANKING	573132	12 827 203 €	0,017
WESTROCK CO	51570	2 482 303 €	0,021
WGL HOLDINGS	16311	1 179 619 €	0,032
WH GROUP	2025504	1 553 002 €	0,014
WHARF HOLDINGS	323581	2 039 779 €	0,011
WHEELLOCK	220881	1 179 001 €	0,011
WHIRLPOOL	30415	5 241 559 €	0,040
WHITBREAD	21000	928 960 €	0,011
WHITEHAVEN COAL LTD	7631	13 674 €	0,001
WHITEWAVE FOODS CO	7520	396 409 €	0,004
WHOLE FOODS MARKET	48583	1 416 841 €	0,015
WIENERBERGER	288968	4 766 527 €	0,246
WILLIAM DEMANT HLD	12954	213 939 €	0,005
WILLIAM HILL	111341	378 528 €	0,013
WILLIS TOWERS WATSON	12187	1 412 872 €	0,009
WILMAR INTL	955399	2 250 874 €	0,015
WINDSTREAM HLDG	22321	155 120 €	0,023
WING TAI HOLDINGS	547814	571 613 €	0,071
WIRECARD	104184	4 260 084 €	0,084
WM,MORRIS,SUPERM,	312090	843 477 €	0,013
WOLSELEY	30353	1 764 428 €	0,012
WOLTERS KLUWER	195923	6 743 670 €	0,065
WOODSIDE PETROLEUM	10758	230 138 €	0,001
WOOLWORTHS	294835	4 878 157 €	0,023
WORKDAY CL A	40646	2 546 854 €	0,033
WORLDLINE	223052	5 973 333 €	0,169
WORLDPAY GROUP	1002624	3 170 199 €	0,050
WORLEYPARSONS	134632	898 409 €	0,055
WPP PLC	126321	2 687 429 €	0,010
WR GRACE DELAWARE	10765	690 348 €	0,015
WS ATKINS	152315	2 601 632 €	0,152
WYNDHAM WORLDWIDE	6637	480 557 €	0,006
WYNN MACAU LTD	525803	793 432 €	0,010
WYNN RESORTS	8267	678 055 €	0,008
XCEL ENERGY	16887	651 624 €	0,003
XEBIO	46000	675 300 €	0,096
XERO LIVE LIMITED	12661	146 476 €	0,009
XEROX ORD,	95456	790 074 €	0,009
XILINX	29270	1 675 307 €	0,012
XINYI GLASS HLDGS	396666	307 529 €	0,010
XINYI SOLAR HLDG	440852	135 852 €	0,007
XL GROUP	305075	10 777 051 €	0,113
XYLEM	25494	1 196 931 €	0,014
YAHOO	43853	1 607 770 €	0,005
YAHOO JAPAN	232700	849 306 €	0,004
YAMABIKO CORP	60000	794 012 €	0,136
YAMADA DENKI	175000	896 190 €	0,018
YAMANA GOLD	95178	253 682 €	0,010
YAMATO KOGYO	133300	3 548 648 €	0,197

YANDEX CL,A	4581	87 429 €	0,002
YANGZIJ,SHIPBUILD	2302477	1 231 473 €	0,060
YANLORD LAND GROUP	668716	579 279 €	0,034
YMAGIS	19074	195 699 €	0,242
YOOX	245467	6 612 881 €	0,270
YPSOMED HOLDING	12500	2 157 183 €	0,099
YRC WORLDWIDE	1173	14 769 €	0,004
YUASA TRADING	25000	592 989 €	0,108
YUE YUEN IND	579572	1 995 066 €	0,035
YUM BRANDS	47108	2 828 490 €	0,013
YUM CHINA HOLDINGS	556	13 769 €	0,000
ZALANDO	54732	1 986 224 €	0,022
ZARDOYA OTIS	293252	2 354 814 €	0,062
ZAYO GROUP HOLDGS	5845	182 097 €	0,002
ZENRIN	59100	1 021 344 €	0,155
ZIMMER HOLDINGS	13377	1 308 847 €	0,007
ZIONS BANCORP	10872	443 642 €	0,005
ZODIAC	939059	20 485 572 €	0,324
ZOETIS INC	117010	5 938 417 €	0,024
ZOJIRUSHI CORP	60000	765 236 €	0,083
ZUMTOBEL	158736	2 696 925 €	0,365
ZURICH FINANC,SCES	14430	3 774 414 €	0,010

OBLIGATIONS

Encours sous gestion dans la poche

14 950 847 544 €

Libellé des valeurs	Quantité de titres	Valeur des titres au 31/12/2016
21ST CEN 3700 150924	1600000	1 553 939 €
21ST CENT FOX 6,9%19	2750000	2 926 528 €
2I RETE GAS 1,125%20	3945000	4 040 796 €
3M CO 1,625 0921	1725000	1 597 982 €
3M CO 2,25 09/26	1500000	1 333 859 €
A2A SPA 1,75% 2025	3900000	4 080 281 €
A2A SPA 3,625% 2022	1500000	1 771 730 €
ABB FINAN 0,625% 23	4350000	4 418 420 €
ABBNEY NAT 0,875% 20	10150000	10 348 214 €
ABBNEY NATL 2% 19	8100000	8 569 138 €
ABBNEY NATL 2,625%20	9370000	10 231 651 €
ABBNEY NATL EUR3M 19	2000000	2 014 868 €
ABBOTT 2,35% 16-19	5795000	5 512 087 €
ABBOTT 2,9% 16-21	2400000	2 272 585 €
ABBOTT 3,4% 16-23	2800000	2 646 564 €
ABBOTT LAB 4,90 46	3500000	3 382 839 €
ABBVIE 3,6% 2025	1196000	1 124 212 €
ABBVIE INC 0,375% 19	11126000	11 202 967 €
ABBVIE INC 1,80%2018	1975000	1 877 462 €
ABBVIE INC 2,30 0521	3000000	2 790 941 €
ABBVIE INC 2,9% 2022	7085000	6 636 039 €
ABBVIE INC 3,2% 26	2725000	2 460 195 €
ABERTI 1000 270227	16000000	15 329 154 €
ABERTIS 1,375% 2026	9900000	10 000 299 €
ABERTIS 2,50%14-2025	4900000	5 538 368 €
ABERTIS IN 3,75 23	3900000	4 701 335 €
ABN AMR BK 4,75% 19	7430000	8 491 915 €
ABN AMR BK 7,125%22	1000000	1 311 438 €
ABN AMRO 2,875%25	5500000	5 867 165 €
ABN AMRO BK 0,625%22	5455000	5 552 329 €
ABN AMRO BK 0,75% 20	2500000	2 568 117 €
ABN AMRO BK 2,5% 23	7900000	8 956 291 €
ABN AMRO BK 4,25%17	1800000	1 740 687 €
ABNAMRO NV 4,125% 22	2300000	2 820 832 €
ACCOR 2,625% 21	2100000	2 321 088 €
ACE HLD 3,35% 24	2500000	2 420 912 €
ACE INA 2,875% 22	4805000	4 590 575 €
ACE INA HOL 3,35% 26	1155000	1 113 859 €

ACEA 3% 16-2026	5200000	4 953 901 €
ACEA SPA 2,625% 24	3200000	3 557 621 €
ACHMEA 4,25% 15-2049	1000000	980 210 €
ACHMEA BK 0,875% 18	10500000	10 679 416 €
ACHMEA BK 1,125% 22	8000000	8 251 611 €
ACHMEA BV 2,5% 20	12370000	13 459 468 €
ACHMEA BV 6% 43	2900000	3 279 657 €
ACMP 4,875% 23	2000000	1 933 863 €
ACTAVIS FU 3% 0320	12185000	11 810 314 €
ACTAVIS FU 3,45%2022	6000000	5 809 045 €
ACTAVIS FUND 3,8% 25	4500000	4 307 035 €
ACTAVIS FUND 3,85%24	3925000	3 762 898 €
ACUITY BANDS 6% 19	600	627 199 €
ADECCO INT 1,50% 22	6517000	6 848 725 €
ADIENT GLO 3,5 0824	3400000	3 482 986 €
ADP 1,50% 2023	4600000	4 902 560 €
ADP 1,5% 07 04 2025	3300000	3 511 580 €
ADP INC 2,25% 20	3300000	3 161 101 €
AEGON NV 1% 23	19550000	19 646 673 €
AEGON NV 4% 2044	2000000	2 046 474 €
AERCAP CAP 3,75% 19	1975000	1 910 977 €
AERCAP IRE 4,5 0521	3600000	3 558 189 €
AEROPORTI 3,25% 21	7057000	7 981 338 €
AETNA 1,7% 2018	2050000	1 944 390 €
AETNA 3,2% 26	3400000	3 184 727 €
AETNA INC 2,40 0621	13500000	12 713 913 €
AETNA INC 2,75%22	900000	841 780 €
AGRIUM 3,15% 22	2350000	2 227 448 €
AGRIUM 3375 150325	1700000	1 573 497 €
AIG 2,3% 07 2019	3200000	3 078 363 €
AIG 6,40 15/12/20	1722	1 860 830 €
AIR LEASE 2,125% 20	4510000	4 225 484 €
AIR LEASE 3% 0323	8572000	7 883 531 €
AIR LEASE 3,375% 21	1375000	1 323 047 €
AIR LEASE 3,75% 2022	1300000	1 282 697 €
AIR LIQ 0750 130624	6800000	6 859 936 €
AIR LIQ 1,75% 270921	960000	880 264 €
AIR LIQ 1250 130628	1200000	1 224 016 €
AIR LIQFIN 1,25 25	26	2 706 215 €
AIR LIQUI 1,375 0919	1550000	1 449 885 €
AIR LIQUIDE 1,875%24	4600000	5 041 660 €
AIR LIQUIDE 2,25% 23	3045000	2 785 912 €
AIRBUS GR 0875 0526	7000000	7 016 266 €
AIRBUS GR 1,375 0531	1368000	1 381 591 €
AKELIUS RSDT 1,5% 22	8700000	8 733 179 €
AKZO NOB 1,125 %26	3200000	3 260 739 €
ALABAMA POW 2,80% 25	2000000	1 858 414 €
ALD INTERNAL 0,75%18	2800000	2 838 512 €
ALD INTERNATIONAL 2%17	2200000	2 244 868 €
ALEXAN 4600 010422	4000000	4 043 465 €
ALEXANDRIA 3,9%2023	2000000	1 920 771 €
ALFA LAVAL 1,375% 22	4000000	4 161 793 €
ALFA SAB 5,25% 24	750000	736 051 €
ALLIANDER 3,25% 2049	1600000	1 676 178 €
ALLIANZ 2,241% 07/45	1300000	1 277 967 €
ALLIANZ 3,375% 24	5100000	5 284 149 €
ALLIANZ 5,75% 2041	165	19 644 846 €
ALLIANZ SE 4,75%2049	600000	667 996 €
ALLIANZ SE 5,625%42	3900000	4 659 556 €
ALLIANZ TV 05-49	13753	14 287 867 €
ALLIED WOR 4,35 1025	3500000	3 331 910 €
ALLSTATE 5,75% 2053	2395000	2 399 953 €
ALLY FCIAL 3,50 19	3600000	3 484 845 €
ALLY FCIAL 4,125% 20	5500000	5 320 076 €
ALPHABET 3,375% 24	1875000	1 863 512 €
ALSTOM S 3% 19	3000000	3 251 407 €

ALSTRIA 2,125% 23	3500000	3 720 330 €
ALTRIA GP 2,625% 26	455000	411 136 €
ALTRIA GROUP 4% 24	4500000	4 569 339 €
ALTRIA GRP 2,85 22	2000000	1 913 815 €
AM AIRLN 3,20% 28	1350000	1 238 989 €
AMADEUS 0,125% 20	4900000	4 887 342 €
AMADEUS CAP 1,625%21	2800000	2 958 605 €
AMADEUS FI 0,625% 17	1900000	1 912 137 €
AMAZON COM 3,80 24	1500000	1 493 055 €
AMAZON,COM 2,5% 22	5600000	5 246 612 €
AME TOW 4,40 150226	415000	408 438 €
AMER INTL 3,30% 2021	665000	651 493 €
AMER INTL 4,875%2022	3800000	3 943 044 €
AMER INTL GP3,9 0426	3805000	3 686 650 €
AMER TOWER 3,4% 2019	1025000	1 005 284 €
AMER TOWER 4,50 18	2431	2 413 852 €
AMER TOWER 5% 24	375000	388 267 €
AMERIC MOV 1,5 0324	5400000	5 502 035 €
AMERIC TOW 3,30% 21	7000000	6 797 339 €
AMERIC TOWER 3,5% 23	374000	360 348 €
AMERICA MO 5,125% 73	3910000	4 170 832 €
AMERICA MOV 4,125%19	6983	7 771 084 €
AMERICAN 0625 221121	7256000	7 318 159 €
AMERICAN 7%18 SR	2100	2 154 436 €
AMERICAN EXPRESS	3000000	2 879 460 €
AMERICAN TOW 4,7%22	2000000	2 047 293 €
AMGEN 2,25% 2019	5450000	5 206 980 €
AMGEN 2,60%17- 2026	2315000	2 038 895 €
AMGEN INC 3,875% 21	9515000	9 477 219 €
AMT 5,9% 2021	2139	2 289 696 €
ANADARKO PE 4,85 321	5000000	5 137 186 €
ANADARKO PE 5,55 326	5200000	5 601 349 €
ANALOG DEVICES	7375000	6 946 589 €
ANGLO AME 3,25% 23	6000000	6 400 418 €
ANGLO AMERI 2,875%20	1000000	1 048 346 €
ANHEUS 2,5% 07/22	2075000	1 951 681 €
ANHEUS 5,375 20	245	258 789 €
ANHEUSER 1,90% 19	6500000	6 220 759 €
ANHEUSER 2,65% 21	20665000	19 882 407 €
ANHEUSER 2625 170123	385000	361 475 €
ANHEUSER 3,30% 23	4000000	3 900 665 €
ANHEUSER 7,75%2019	185	201 618 €
ANHEUSER-B 0,875% 22	14200000	14 665 861 €
ANHEUSER-B 1,5% 25	16585000	17 449 366 €
ANHEUSER-B 2% 28	2560000	2 748 020 €
ANHEUSER-B 2,75% 36	16634000	18 595 278 €
ANHEUSER-BUS 3,65%26	25385000	24 663 315 €
ANZ NZ 2,85% 15-2020	2300000	2 218 022 €
AON 2,875% 14-2026	6696000	7 439 673 €
AON 4%13-2023	2250000	2 211 458 €
AON PLC 3,50% 24	1000000	949 848 €
APACHE 2625 150123	3000000	2 763 714 €
APPLE 1% 13-2023	10300000	9 738 124 €
APPLE 2850 0223	6870000	6 600 020 €
APPLE 3250 0226	10730000	10 289 576 €
APPLE INC 1,375% 24	2990000	3 195 720 €
APPLE INC 1,625% 26	4300000	4 593 931 €
APPLE INC 1550 0821	4290000	3 951 727 €
APPLE INC 2,25 21	4600000	4 391 315 €
APPLE INC 2,85 21	790000	768 197 €
APPLE INC 2450 0826	560000	502 413 €
APRR 1,25% 27	1400000	1 405 287 €
APRR 1,50%15-2024	3700000	3 924 092 €
APRR 1,875% 31	800000	811 377 €
AQUAR IN Eurib3 17	65	6 505 945 €
AQUARIUS 4,25%2043	10452000	11 629 231 €

ARCELOR 2,875% 2020	1000000	1 062 277 €
ARCH CAPFI 4,01 26	4250000	4 086 158 €
ARKEMA 1,50%2025	2300000	2 407 367 €
AROUNDTOWN 1,50% 24	7600000	7 181 406 €
AROUNDTOWN PRO1,5%22	2000000	1 967 240 €
ARRFP 1,125% 14-2021	3200000	3 336 663 €
ARROW ELEC 3,50% 22	3750000	3 542 399 €
ASB FIN 0500 170620	4500000	4 558 834 €
ASML HOLD 0,625%22	1362000	1 368 444 €
ASML HOLD 1,375%26	1158000	1 163 699 €
ASML HOLDG 1,625% 27	1400000	1 411 188 €
ASML HOLDI 3,375% 23	2000000	2 347 076 €
ASPA 3,875%16-2026	900000	960 794 €
ASR NLD 5 PERP	6944000	7 269 248 €
ASR NLD 5,125 45	2283000	2 444 095 €
ASSI GEN 5,125% 0924	5000	6 493 286 €
ASSIC GENER 2,875%20	8594000	9 476 195 €
ASSICU GEN 7,75%42	3700000	4 417 139 €
ASSICURA 4,125% 26	1300000	1 418 180 €
ASSICURAZ 10,125% 42	7000000	9 440 702 €
ASSICURAZI EI03M 47	1530000	1 605 436 €
ASSOC BANC 2,75%2019	4200000	4 006 274 €
ASTRAZ 0,875% 241121	3200000	3 295 289 €
ASTRAZE 075 0524	12200000	12 240 969 €
ASTRAZEN 025 0521	700000	703 426 €
ASTRAZENEC 2,37 20	3300000	3 123 768 €
AT & T 3,80% 16-2022	10000000	9 792 378 €
AT & T 5,20% 16-2020	4928000	5 096 755 €
AT AND T 2,45% 2020	385000	362 004 €
AT AND T 3% 06 2022	8300000	7 731 663 €
AT& T INC 3,40% 25	2000000	1 831 301 €
AT&T 1,30% 2023	7276000	7 420 299 €
AT&T 2,40% 2024	3150000	3 469 590 €
AT&T 2,45% 2035	7956000	7 893 831 €
AT&T 3,875% 2021	3000	2 975 680 €
AT&T INC 2,625% 2022	2500000	2 276 154 €
AT&T INC 3,375% 34	1358000	1 529 500 €
AT&T INC 3,55% 32	4078000	4 610 476 €
AT&T INC 3,6% 23	9624000	9 280 282 €
AT&T INC 4125 022026	2150000	2 089 934 €
ATF NETH 2125 130323	5700000	5 669 491 €
ATLANTIA 2,875%2021	4600000	5 197 607 €
ATLANTIA 3,625%2018	3500000	3 750 063 €
ATR DU SUD 2,875%23	8500000	9 910 828 €
ATRIUM 3,625% 2022	1580000	1 727 049 €
ATT INC 2,75% 16-23	8100000	9 051 697 €
AUST & NZ BK 0,75%26	5100000	4 973 684 €
AUST&ANZ BK 1,875%17	2428000	2 321 063 €
AUSTRAL PAC 3,125%23	4440000	5 173 206 €
AUTO SUD 2,95% 24	4900000	5 778 441 €
AUTODESK 1,95%2017	1300000	1 232 548 €
AUTODESK 3600 1222	7975000	7 598 914 €
AUTONATIO 4,5 1025	3692000	3 570 503 €
AUTOROUTES PARIS	12000000	12 122 464 €
AUTOSTRIDE 1,125% 21	3200000	3 314 977 €
AUTOSTRDE 1,75 27	5169000	5 243 836 €
AVALONBAY 2,95% 26	2325000	2 103 857 €
AVALONBAY 4,20% 2018	3200000	3 209 446 €
AVIATION CP 2,875%18	2000000	1 935 293 €
AVIVA 0,10% 2018	2500000	2 503 719 €
AVIVA PLC 0,625% 23	6850000	6 727 455 €
AVIVA PLC 3,875% 44	1250000	1 311 028 €
AVNET 4,875% 22	6300000	6 249 852 €
AVNET INC 4,625 0426	1100000	1 034 723 €
AXA 3,941%29/11/2049	8927	9 300 523 €
AXA 5,125%13-2043	4000000	4 709 558 €

AXA SA 1,125% 28	2300000	2 302 249 €
AXA SA 3,375% 47	5000000	5 162 843 €
AXA SA 5,25%04-40	100	5 742 191 €
AXA VRN 10/99	2000000	2 070 960 €
AXP 2,65% 02/12/22	3500000	3 267 914 €
B IRELAND TF/TV 24	7600000	7 998 896 €
BAA 4,6%20 EMTN	4700	5 128 520 €
BAA FUNDING 4,375%17	7600000	7 931 210 €
BABCOCK INTL 1,75%22	5867000	6 113 591 €
BALL 3,50%15-2020	1000000	1 102 143 €
BALL CORP 4% 23	2000000	1 887 681 €
BALTIMORE 2,4 08/26	2125000	1 886 205 €
BAN OF AM 2,151 1120	10250000	9 600 608 €
BANK AMER 4,45% 26	2425000	2 393 503 €
BANK AMER,5,75%17	549	2 706 510 €
BANK IRELAND 3,25%19	6134000	6 709 948 €
BANK OF AM 2,625% 21	3230000	3 057 687 €
BANK OF AMER 2,05%18	3095000	2 949 704 €
BANK OF AMER 2,6% 19	10200000	9 874 758 €
BANK OF AMER 2,65%19	3200000	3 084 255 €
BANK OF AMER 3,3%30	15738000	15 171 596 €
BANK OF AMER 4,10%23	1800000	1 806 325 €
BANK OF AMER 5% 21	1200	6 195 528 €
BANK OF AMER CRP	6455000	6 486 386 €
BANK OF NY M 3 1028	1800000	1 619 320 €
BANK OF NY MELLO	5000000	4 748 498 €
BANQ FED 2,5 04/21	2800000	2 648 510 €
BARCL LOND 6% 2021	2050	2 494 433 €
BARCLAYS 1,50% 2022	3700000	3 788 196 €
BARCLAYS 4,375%26	1500000	1 473 981 €
BARCLAYS 1,875 0321	4527000	4 737 721 €
BARCLAYS 1,875 1223	23127000	23 420 658 €
BARCLAYS 2,625% 2025	4950000	4 928 773 €
BARCLAYS 2,75% 2019	1420000	1 349 177 €
BARCLAYS 3,20% 2021	1900000	1 805 012 €
BARCLAYS 6%18 EMTN	3900	4 357 483 €
BARCLAYS BK 5,14%20	9150	9 248 332 €
BARCLAYS BK 6,625%22	2500	3 188 927 €
BARRICK GOLD 4,10%23	1650000	1 616 005 €
BARRICK NO 4,40% 21	235000	236 994 €
BARRY 2375 24/05/24	400000	414 646 €
BARRY CALL 5,375% 21	1000000	1 235 070 €
BASF FIN 0 11/20	5882000	5 877 646 €
BASF FIN EU 0,75%26	4300000	4 231 470 €
BAT HLD 2,375% 23	3000000	3 355 545 €
BAT HLDNV 3,125% 29	1034000	1 216 508 €
BAT IF 1,25% 2027	5600000	5 592 624 €
BAT INTL 5 3/8%17	3222	3 457 936 €
BAT INTL FIN,1%15-22	6700000	6 891 762 €
BAXALTA 4%230625	2600000	2 473 749 €
BAXTER INTL 2,60% 26	3945000	3 487 500 €
BAYER AG 2,375% 75	3649000	3 498 289 €
BAYER US FINANCE	8000000	7 626 676 €
BB&T CO 2050 150521	6725000	6 267 221 €
BB&T CORPOR 2,45% 20	10400000	10 012 786 €
BBVA BANC 6,50% 21	4000000	4 166 613 €
BBVA SENIOR 2,375%19	8500000	9 091 421 €
BBVA SUB 3,5% 24	6000000	6 409 911 €
BEAR 7,25%18 SR	2300	2 372 121 €
BECTON DICK 1,9 1226	1960000	2 020 898 €
BECTON DICK,2,675%19	240000	231 221 €
BECTON DICK,3,734%24	1063000	1 028 970 €
BECTON DICKI 1 1222	6693000	6 797 809 €
BELFIUS BK 2,25% 18	6800000	7 099 895 €
BELFIUS BK 3,125% 26	13800000	14 255 421 €
BELGACOM 2,375% 2024	2000000	2 266 861 €

BEMIS CO 6,8% 0819	2500	2 690 659 €
BERKSH HAT 1,125%27	4150000	4 102 392 €
BERKSHIRE 1,7% 19	7000000	6 662 822 €
BERKSHIRE 2,20%16-21	6400000	6 075 387 €
BERKSHIRE 2,75%16-21	5020000	4 774 760 €
BERKSHIREH 1,30% 24	4159000	4 318 231 €
BERTEL 1,125% 26	7500000	7 651 591 €
BERTELSMANN 2,625%22	4000000	4 543 581 €
BFCM 0,25 06/19	4400000	4 430 031 €
BFCM 1,25% 25	13000000	13 497 216 €
BFCM 1,625% 26	6000000	6 398 060 €
BFCM 1,875% 16-2016	7400000	7 141 163 €
BFCM 2,625% 03/24	6000000	6 901 742 €
BFCM 2,625% 21	18300000	20 524 178 €
BFCM 2,75% 15/10/20	3300000	3 156 646 €
BFCM 3% 13-2023	8300000	9 616 045 €
BFCM 3% 14-2024	9800000	10 783 588 €
BFCM 3,25% 08/22	400000	466 055 €
BFCM 4% 22/10/20	2000000	2 283 247 €
BFCM 4,125% 2020	3000000	3 478 444 €
BG ENERGY 3,625%19	2000	2 216 734 €
BG ENERGY 3% 2018	2200	2 331 932 €
BHARTI AIR 4% 18	3859000	4 133 273 €
BHP 6750 102075	3325000	3 557 963 €
BHP BILL 3,125% 33	800000	968 359 €
BHP BILLI TF/TV 79	2365000	2 693 140 €
BHP FIN 0,75 22	4000	4 056 826 €
BHP FINANCE 3,85%23	3250000	3 274 557 €
BIMBO 3,875% 24	1700000	1 600 798 €
BIOGEN INC 3,625% 22	9900000	9 728 200 €
BIOGEN INC 4,05% 25	1150000	1 131 754 €
BK AME,4%18 EMTN	46	2 301 465 €
BK AMERICA 0,75% 23	8100000	8 011 825 €
BK AMERICA 3,875%25	5550000	5 420 748 €
BK NOVA 2800 210721	6625000	6 394 895 €
BK NY MELLON 2,60%20	4460000	4 290 339 €
BK OF A 2503 211022	1875000	1 729 044 €
BK OF A 3248 211027	2465000	2 243 066 €
BK OF AME 1,625 0922	8880000	9 330 312 €
BK OF AMER 2,375% 24	10121000	11 159 007 €
BK OF NY 2,20% 2019	3800000	3 629 034 €
bK OF NY M 2,45 1120	5000000	4 740 252 €
BK OF NY ME 4,95% 20	3650000	3 494 561 €
BK POSTALE 2,75% 26	7000000	7 345 289 €
BKAMERICA 1,375% 25	3000000	3 070 375 €
BKAMERICA 2,50% 2020	8584000	9 349 528 €
BKAMERICA 3,50 26	9300000	8 750 058 €
BKAMERICA 4% 01/25	5200000	5 010 543 €
BLACK 4,25% 11/23	6000000	5 936 982 €
BLACK HILLS 2,50%19	840000	809 572 €
BLACK HILLS 3,15% 27	1075000	983 058 €
BMBG BOND 3%2021	2800000	2 918 300 €
BMW FIN 0,125% 20	4550000	4 569 465 €
BMW FIN 0,75% 24	3150000	3 188 975 €
BMW FIN 3,25% 19	5000000	5 487 539 €
BMW FINANCE 1% 2025	2150000	2 210 049 €
BMW FINANCE 1,5%18	6060000	6 245 620 €
BMW US CA 1,125% 21	4500000	4 698 254 €
BNP 0,5 010622	9708000	9 724 070 €
BNP 0,75% 16-2022	21090000	21 269 896 €
BNP 2,375% 20/05/24	8355000	9 384 176 €
BNP PAR,5,019% 17	8200000	8 549 478 €
BNP PARIB 1,12 23	8906000	9 258 309 €
BNP PARIB 2,25% 21	9700000	10 696 352 €
BNP PARIB 2,625% 27	5900000	6 076 745 €
BNP PARIB 3,75% 20	12260000	14 023 100 €

BNP PARIB 4,375% 26	3500000	3 307 740 €
BNP PARIBAS	3300000	3 743 347 €
BNP PARIBAS 1,375%18	3000000	3 080 938 €
BNP PARIBAS 1,50% 28	4564000	4 712 463 €
BNP PARIBAS 2% 2019	4000000	4 237 637 €
BNP PARIBAS 2,25%27	6050000	5 933 086 €
BNP PARIBAS 2,875%26	15142000	16 105 243 €
BNP PARIBAS TV08-18	72	4 061 099 €
BNPP 5% 15/01/2021	3000	3 153 281 €
BNPP CA 4,032% 99	3400000	3 396 781 €
BNZ INTL 1,25% 18	4900000	5 027 190 €
BOA 1,65% 18	3680000	3 503 240 €
BOA 1,875% 19	11829000	12 485 106 €
BOA 3,95% 2025	3000000	2 844 928 €
BOA 4,2% 24	2705000	2 645 527 €
BOA 5,625% 2020	1660	8 639 043 €
BOA CORP 1,375% 21	10325000	10 801 454 €
BORG-WAR 1,80% 1122	5000000	5 223 337 €
BOSTON PP 3,85% 23	4000000	3 938 827 €
BOSTON PRO 3,65% 26	2900000	2 755 636 €
BOSTON PRO 3,8% 24	2225000	2 169 215 €
BOUYGUES 4% 02/2018	4000000	4 317 966 €
BP 3,561% 2021	9800	9 730 879 €
BP CAP 1953 0325	12300000	13 345 608 €
BP CAPIT 1,526% 22	14200000	15 017 487 €
BP CAPIT 3,119% 26	1000000	926 547 €
BP CAPIT MA 1676 519	7000000	6 602 441 €
BP CAPITAL 1,109%23	2650000	2 740 092 €
BP CAPITAL 1,573%27	4000000	4 159 081 €
BP CAPITAL 2,213% 26	1576000	1 723 319 €
BP CAPITAL 2,994% 19	2500000	2 725 677 €
BP CAPITAL PLC	2425000	2 229 172 €
BP CAPMKT 2,177% 21	6119000	6 696 707 €
BP CAPMKTS 1,117 24	16974000	17 276 691 €
BP CAPMKTS 3,06 22	1200000	1 158 185 €
BPCE 0,375% 05/10/23	4700000	4 600 006 €
BPCE 0,625% 20/04/20	8200000	8 361 303 €
BPCE 1% 05/10/2028	2400000	2 316 447 €
BPCE 1,125%15-2022	7000000	7 233 915 €
BPCE 2,125% 2021	1700000	1 860 456 €
BPCE 2,65% 16-2021	6000000	5 737 069 €
BPCE 2,75% 11/2027	2000000	2 070 854 €
BPCE 2,875% 24	500000	586 444 €
BPCE 2,875% 26	8200000	8 589 697 €
BPCE 3% 14-2024	400000	471 454 €
BPCE 4,25% 02/2023	1700000	2 143 345 €
BPCE 4,625% 23	6400000	7 662 650 €
BPCE 5,15% 14-2024	4300000	4 235 795 €
BPCE 5,7% 2023	2375000	2 398 054 €
BPCE SA 08/07/2026	7100000	7 446 911 €
BRAMBLES 4,625% 18	5000	5 455 426 €
BRAMBLES U 4,125% 25	1600000	1 552 353 €
BRANCH BKG 1,45%2019	5000000	4 690 046 €
BRISA CONCES 2% 23	4100000	4 255 046 €
BRISTOL SQ 0,875% 17	5550000	5 273 450 €
BRIT SKY 2,625% 19	4701000	4 500 204 €
BRITAM TOB 3,625% 21	4000	4 643 892 €
BRITISH SKY 1,50% 21	9048000	9 450 976 €
BRITISH TEL 0,625%21	5370000	5 448 663 €
BRITISH TEL 1,75% 26	10650000	11 161 363 €
BRIXMOR 3850 010225	2500000	2 364 042 €
BRIXMOR OP 3,25 0923	5307000	4 926 599 €
BRK 3,45% 2021	2600	2 595 321 €
BROADDRID 3,95% 2020	1200000	1 197 048 €
BROOKFIELD 4,25 626	7150000	6 707 651 €
BT 1,125 10/03/23	3000000	3 077 793 €

BUCKEYE PART 3,95%26	2075000	1 924 451 €
BUNDERSREPUB DEUTSCH	10000000	15 234 913 €
BUNGE FI 1850 160623	2179000	2 266 789 €
BUNGE FIN 3,25% 2026	2205000	2 027 552 €
BURL NTHN 3,65 0925	2620000	2 615 932 €
BURLINGTON 3% 0425	1600000	1 520 381 €
BURLINGTON 305% 0922	1900000	1 857 840 €
BURLINGTON N 4,1 621	1600000	1 613 686 €
C AGRICOLE 2,625%18	3400000	3 274 761 €
CA ASSUR 4,25% 2025	12700000	13 024 613 €
CA ASSUR 4,5% 49	8800000	8 760 400 €
CA LOND 1,25 140426	12200000	12 418 964 €
CA LONDON 2,375% 21	3300000	3 069 489 €
CA LONDON 2,375% 24	15000000	16 861 107 €
CA LONDON 3,125% 23	8900000	10 416 515 €
CADES 4,125 04/23	39952000	51 152 338 €
CAJA 2,375% 2019	2200000	2 337 539 €
CAMPO FOOD 3,37 22	1500000	1 568 993 €
CAN IMPERIAL BK	5929000	5 629 905 €
CAP GEMINI 1,75% 20	16100000	16 984 368 €
CAP GEMINI EURIB 18	2000000	2 014 190 €
CAPGEMINI 0,50 1121	4400000	4 405 917 €
CAPITA OBAK 3,375 23	3503000	3 326 829 €
CAPITAL ONE 1,65% 18	1895000	1 803 632 €
CAPITAL ONE 2,95% 21	11500000	11 065 459 €
CAPITAL ONE 5,50% 24	4056000	3 818 680 €
CARGILL INC 2,5% 23	2461000	2 787 520 €
CARLSBERG 2,5% 24	8900000	9 910 009 €
CARMILA 2,375% 23	12400000	13 300 004 €
CARMILA 2,375% 24	2100000	2 228 380 €
CARREFOUR 1,75 22	7000000	7 484 095 €
CARREFOUR 1,75%2019	4200000	4 416 285 €
CARREFOUR SA	9500000	9 458 483 €
CARREFR Eurib3 20	3100000	3 105 775 €
CASINO 3,157%2019	1200000	1 333 909 €
CASINO 3,248%14-2024	4000000	4 371 295 €
CASINO 3,994% 03/20	1500000	1 733 636 €
CASINO 4,726% 21	4300000	5 158 999 €
CATERPILL 3,90 0521	4000000	4 006 207 €
CBL ASSOC LP 5,95 26	4770000	4 554 761 €
CBS 2,90%16-2027	3500000	3 114 665 €
CBS CORP 3,7% 08/24	4700000	4 533 518 €
CBS CORPO 4% 2026	3200000	3 135 253 €
CCHLN 1,875%16-2024	3700000	3 916 063 €
CELANES US 1,125 923	6750000	6 771 163 €
CELG 3,875% 15/08/25	1000000	974 335 €
CELGENE 2,125% 2018	1045000	1 002 124 €
CELGENE 3,55% 2022	6050000	5 952 807 €
CELLNEX 2375 160124	700000	697 945 €
CENTENE CORP	3500000	3 556 826 €
CENTURYLIN 6,45 21	3485	3 486 068 €
CF INDUS 3400 011221	2000000	1 877 896 €
CF INDUST 6,875%2018	1300000	1 311 786 €
CF INDUSTRI 4,5 1226	2425000	2 270 752 €
CF INDUSTRIE 3,45%23	1150000	971 482 €
CFCM NORD 2,125%26	3500000	3 383 411 €
CFSC 2,25%12/19	2250000	2 145 953 €
CHARTER COMM OPT	4830000	4 860 993 €
CHEVRON 1,345% 17	1750000	1 662 277 €
CHEVRON 2,566% 23	13700000	12 836 794 €
CHEVRON 3,191%23	2000000	1 939 256 €
CHEVRON CO LIB1119	5000000	4 747 968 €
CHEVRON CORP 2,35%22	5000000	4 653 152 €
CHRTER C OT 4,908 25	15233000	15 456 942 €
CHVR PHILLIPS 3,4%26	1596000	1 512 249 €
CIE ST GOBAIN 0%20	3300000	3 283 562 €

CIMAREX 5,875 0522	6850000	6 815 608 €
CISCO SYS 1,4% 18	6650000	6 338 346 €
CISCO SYSTEM 1,85%21	6740000	6 255 473 €
CISCO SYSTEM 2,5% 26	1390000	1 260 207 €
CISCO SYSTEMS	4000000	3 871 502 €
CIT GROUP 5,375% 20	3000000	3 035 028 €
CITIGR L3MUS 0923	3265000	3 157 725 €
CITIGROU I 2,65 1020	7000000	6 664 711 €
CITIGROUP 1,85% 17	3875000	3 686 851 €
CITIGROUP 0,75% 2023	14816000	14 551 213 €
CITIGROUP 1,375% 21	14590000	15 249 600 €
CITIGROUP 1,50% 2028	2800000	2 716 045 €
CITIGROUP 1,75% 2025	1767000	1 860 979 €
CITIGROUP 1,80% 2018	7575000	7 230 776 €
CITIGROUP 2,125% 26	7650000	8 137 829 €
CITIGROUP 2,15% 2018	5540000	5 314 392 €
CITIGROUP 2,50% 2019	3800000	3 662 387 €
CITIGROUP 3,375%2023	9000000	8 643 797 €
CITIGROUP 3,4% 26	3400000	3 146 356 €
CITIGROUP 5%19EMTN	12148	13 960 631 €
CITIGROUP 5,50% 25	7045000	7 409 030 €
CITIGROUP I 3,30 425	3300000	3 076 871 €
CITIGROUP I 4,6 0326	5000000	4 953 459 €
CITIGROUP7,375%04/19	4072	4 968 154 €
CITIGRP 4,75%19MTN	2800	2 805 942 €
CITIZENS 2550 130521	3400000	3 203 989 €
CITIZENS BANK 2,5%19	5770000	5 534 869 €
CITIZENS BK 230 1218	8400000	8 016 809 €
CITY NATIONAL	2300	2 417 451 €
CLOVERIE 1,75% 2024	20796000	22 124 877 €
CNA 3,95% 05/2024	3500000	3 367 121 €
CNCEP 6,117%07-2017	5000000	5 232 866 €
CNH IND CP 4,375% 20	2000000	1 956 293 €
CNH IND FIN 2,75% 19	4100000	4 339 828 €
CNH INDUS 3,875%18	3500000	3 418 066 €
CNP 4,25% 2045	1500000	1 581 199 €
CNP 4,5% 15-2047	700000	735 742 €
CNP ASSU 4% 99	2000000	2 026 150 €
CNP ASSUR 1,875 1022	6200000	6 308 543 €
CNP ASSUR 8,875 2041	2000000	2 393 004 €
COCA COL Eurib3 19	1514000	1 517 391 €
COCA-CO 1100 020936	1765000	1 605 433 €
COCA-COLA 0,75%2022	1450000	1 473 440 €
COCACOLA 0,75% 2023	5330000	5 465 256 €
COCA-COLA 1,125% 27	2200000	2 244 175 €
COCA-COLA 165 0318	6750000	6 454 578 €
COCA-COLA 2,375% 20	7300000	7 893 547 €
COCA-COLA 3,30 0921	4500000	4 492 136 €
COCA-COLA 3,8% 11/25	1900000	1 815 736 €
COFIROUTE 0375 0225	10000000	9 588 615 €
COFIROUTE 5%240521	4300000	5 332 184 €
COLUMBIA PIPELIN	5150000	5 146 582 €
COM BK AUST 1,625%19	8720000	9 148 653 €
COM BK AUST 2% 27	4800000	4 893 094 €
COMCAST 1,625% 2022	1450000	1 323 158 €
COMCAST 3,125 22	5100000	4 997 332 €
COMCAST 3,375% 2025	2690000	2 603 606 €
COMCAST 5,15% 2020	4000000	4 203 911 €
COMCAST 9,455% 02-22	651	842 033 €
COMCAST CORP 5,7%19	2355	2 439 517 €
COMMERZB 4% 0326	4000000	4 229 995 €
COMMERZBK 0,50% 2023	5989000	5 720 339 €
COMMON BK 1,75% 18	3800000	3 603 083 €
COMMONW BK 2,55%2021	6000000	5 698 971 €
COMPASS GRP 1,875%23	3650000	3 997 087 €
CONCHO RES 5,50 23	3375000	3 342 301 €

CONOCOPHIL CO	3000000	2 750 510 €
CONT AIRLN 4% 26 A	6000	4 978 733 €
CONT AIRLN 7,25% 21	605	431 867 €
CONTIGUMMI 2,50%2017	4100000	4 203 421 €
CONTIN 0000 050220	7067000	7 042 649 €
CONTINENTL 3,125% 20	4100000	4 584 074 €
CONTL RUB 0,50% 19	6721000	6 823 127 €
CORRECTIONS 5%2022	2250000	2 159 576 €
COV BLDG STE 2,25%17	6410000	6 552 574 €
COVENTRY 5,45%11-21	4225	4 437 653 €
COVENTRY BG 2,5%20	4600000	4 962 669 €
COVIDIEN I 4,20 20	328	330 738 €
COX COMMUN 3,35% 26	4750000	4 310 565 €
CPL ONE BANK 2,4% 19	1500000	1 436 203 €
CR SUISSE 0,375% 19	9600000	9 688 120 €
CR AGRICOLE 3,875%19	5400000	6 025 335 €
CR SUISSE 0,5% 0318	2000000	2 020 013 €
CR SUISSE 1,375% 19	8995000	9 321 482 €
CR, AGRI,ASSU TV48	5200000	5 331 812 €
CRD MU ARK 3,25 0626	1500000	1 591 554 €
CRE SUISSE 1,5% 2026	16600000	17 240 531 €
CREAGR 0,875% 2022	17800000	18 352 028 €
CREAGR LONDN 0,75%22	12400000	12 527 236 €
CRED AGRI 3,875% 24	2427000	2 397 457 €
CRED SUIS 1,125% 20	3200000	3 311 476 €
CRED SUIS 1,75% 2018	2925000	2 787 765 €
CRED SUIS GP 1,25%22	6489000	6 550 840 €
CRED SUIS NY 1,7% 18	3195000	3 028 885 €
CRED SUIS NY 3,62%24	5025000	4 845 203 €
CRED,AGRIC,8,2% 2018	7000000	7 987 944 €
CREDI AGRI 2,625% 27	4000000	4 171 163 €
CREDIT AG 1,875 1226	10100000	10 134 104 €
CREDIT SUIS 1% 2023	12345000	12 567 983 €
CRH FIN VRN 21	3200000	3 414 445 €
CRH FINA 1375 181028	6874000	6 751 950 €
CRH FINANCE 3,125%23	5155000	6 017 967 €
CRH FINLAND 2,75%20	3200000	3 499 506 €
CRITERI S 1,625 22	15	1 512 082 €
CROWN CASTL 3,222%22	2000000	1 901 228 €
CROWN CASTL 3,4 0221	11500000	11 184 708 €
CROWN CASTLE 5,25%23	2021000	2 123 246 €
CROWN CST 6,113 20	800000	825 808 €
CROWN EUROPEAN	3700000	3 649 514 €
CROWN EUROPEAN 4%22	1500000	1 680 955 €
CS AG 5,75% 09/25	3700000	4 103 064 €
CS GR FDG 3,45% 21	8000000	7 689 020 €
CS LONDON 1,375%22	18779000	19 829 411 €
CS NY 5,3 08/19	2095	2 177 441 €
CSC HOLDIN 5,5 0427	1700000	1 657 020 €
CSNY 3% 29/10/21	4000000	3 829 988 €
CSTEL BRD 4,75 25	7400000	7 457 924 €
CUBESMAR L 3,125 926	975000	874 882 €
CVS 4% 05/12/23	1260000	1 249 766 €
CVS CARRK 2,75% 22	1390000	1 297 049 €
CVS HEALTH 2,125 621	355000	330 039 €
CVS HEALTH 2,80% 20	3600000	3 498 778 €
CVS HEALTH 2,875% 26	2825000	2 548 661 €
CVS HEALTH 3,50% 22	4265000	4 208 679 €
CVS HEALTH 3,875% 25	2656000	2 633 439 €
DAIMLER 0,625% 0320	4200000	4 295 417 €
DAIMLER 0,75%16-2023	2350000	2 400 265 €
DAIMLER AG 0,875%21	12300000	12 761 253 €
DAIMLER AG 025 0520	1950000	1 963 840 €
DAIMLER BZ 0,50 19	12864000	13 054 340 €
DAIMLER BZ 2,25% 22	3000000	3 357 262 €
DAIMLER FI 2,25 19	8300000	7 954 603 €

DAN BANK 2,75% 05/26	2000000	2 163 772 €
DANFOSS 1,375% 2022	3577000	3 754 878 €
DANONE	4985000	4 563 376 €
DANONE 0,424 22	4800000	4 783 091 €
DANONE 1,125 25	4600000	4 723 601 €
DANONE 1,208% 2028	8200000	8 076 563 €
DANONE 1,691%16-2019	3575000	3 357 023 €
DANONE 2,6% 2023	1100000	1 252 218 €
DANONE EMTN 709 1124	8900000	8 799 338 €
DANSKE BANK 0,5%16	1250000	1 269 800 €
DANSKE BANK 0,75%23	6090000	6 172 475 €
DANSKE BK 3,875% 23	5050000	5 396 796 €
DARDEN 6,8%07-2027	4185	4 568 330 €
DB AG 5 24/06/20	30	1 647 134 €
DBR 2,50% 2044	5000000	7 020 084 €
DELPHI AUTO 1,6 0928	2718000	2 636 218 €
DELPHI AUTOM 1,5% 25	1900000	1 923 960 €
DELTA LLOYD 9% 42	5617000	7 197 147 €
DEMETER INV 4,375%25	2465000	2 584 931 €
DEU,TELEK,8,25%30	100	138 764 €
DEUT BAHN 0,875%31	12385000	11 776 391 €
DEUT TEL FI 0,625%23	14005000	14 148 326 €
DEUT TEL FIN 1,5% 28	16340000	16 760 538 €
DEUTANNIG TF/TV 74	2000000	2 170 175 €
DEUTS BK LD 2,5% 19	2500000	2 378 671 €
DEUTSC ANN 2,125%22	5200000	5 615 780 €
DEUTSCH BK AG 1% 19	13000000	13 182 571 €
DEUTSCHE 0625 151221	3000000	3 019 822 €
DEUTSCHE 1,25% 09/21	5900000	5 948 343 €
DEUTSCHE 2,375%2022	3500000	3 947 084 €
DEUTSCHE 3,125%2019	9400000	10 233 910 €
DEUTSCHE 4% 31/12/99	6200000	6 409 904 €
DEUTSCHE AN 3,625%21	4590000	5 277 188 €
DEUTSCHE AN,0,875%20	4600000	4 705 840 €
DEUTSCHE TEL 0,25%16	6000000	6 028 970 €
DEUTSCHE TEL2,125%21	740000	814 052 €
DEUTSCHE W 1,375% 20	8764000	9 141 764 €
DEVON ENGY 3,25% 22	559000	528 401 €
DH EUROP FN 170 0122	4623000	4 999 787 €
DH EUROPE FI 2,50%25	4812000	5 413 599 €
DIAMOND FIN 3,48%19	4275000	4 147 517 €
DIAMOND1 2, 4,42%21	5500000	5 401 736 €
DIAMOND1 TF 5,45%23	4400000	4 424 228 €
DIGITAL 3950 0722	4875000	4 741 097 €
DIGITAL EUR 2,625%24	1090000	1 142 652 €
DISCOV BK 3,20 0821	445000	428 904 €
DISCOV FIN 3,95% 24	1775000	1 665 569 €
DISCOVER 3,85% 2022	3000000	2 889 658 €
DISCOVER BK 2% 18	2000000	1 909 011 €
DISCOVER BK 8,7%19	506	548 748 €
DISCOVERY 4,90%16-26	440000	442 468 €
DISCOVERY 5,625%19	1225	1 276 224 €
DISH DBS 7,875 19	2000000	2 150 642 €
DNB BANK 4,75%2022	3050000	3 193 781 €
DNB BK 1125 0323	8400000	8 792 020 €
DOLLAR GL 3,25% 2023	5980000	5 638 136 €
DOMINION 1,6%16-2019	1125000	1 057 397 €
DOMINION RES 5,2%19	2255	2 340 886 €
DOW CHEMI 3,5% 1024	2645000	2 545 166 €
DTE ENERGY 3,85% 23	2700000	2 651 763 €
DUFYR FIN 4,50 22	1000000	1 073 620 €
DUKE ENERGY 3,8% 23	1825000	1 830 033 €
DUKE ENERGY 1,80%21	6285000	5 760 868 €
DUKE ENERGY 5,05% 19	2040	2 106 032 €
DUKE NRGY 3,95% 2023	1225000	1 219 190 €
DUKE REAL 6,5% 18	2700000	2 760 552 €

DUKE REALTY	2000000	1 918 865 €
E,ETAT 3,75%05 OAT	693509779	835 145 733 €
E,ETAT 8,5%92 OAT	694313356	1 108 372 547 €
E,ON 5,50%021017	5000	5 280 719 €
EASTMAN CHEMI 3,6%22	3717000	3 655 893 €
EASTMAN CHMC 2,8% 25	1300000	1 258 712 €
EASTMN CHM 2,70 20	1300000	1 255 050 €
EASYJET 1,75 23	3000000	3 124 604 €
EATON 2,75%2022	2200000	2 067 452 €
EATON CAP,0,75%2024	1988000	1 956 904 €
EBAY 2,6%12-2022	4000000	3 717 081 €
EBAY INC 2200 010819	2000000	1 912 816 €
ECOLAB 2,625% 2025	2966000	3 333 316 €
ECOLAB INC 1 24	7603000	7 625 888 €
EDF 1% 13/10/2026	15600000	15 047 192 €
EDF 1,625% 271125	4300000	4 555 407 €
EDF 1,875% 36	6000000	5 456 841 €
EDF 4,125%01/49	2000000	2 047 011 €
EDF 4,25% 49	8000000	8 486 047 €
EDF 4,625 04/30	900000	1 189 050 €
EDF 5% 14-2049	1500000	1 501 279 €
EDF 5,375% 2049	1400000	1 472 312 €
EDISON INC 2% 0521	2700000	2 507 315 €
EDP FIN 1,125% 2024	7350000	6 991 847 €
EDP FINA 4,125% 0121	1090000	1 260 976 €
EDP FINAN 2,625% 22	6450000	6 959 964 €
EDP FINANC 2,625% 19	600000	639 346 €
EDP FINANC 4,875% 20	12955000	14 969 766 €
EL PASO 6,5% 2020	2525000	2 713 812 €
EL PASO OP 6,50% 20	3238000	3 437 306 €
ELM 5,849%07-2017	8950000	9 398 893 €
EMBRAER NL 5,05% 25	2000000	1 870 634 €
EMER US FI 2,15 0619	385000	364 557 €
EMERA US 2700 150621	535000	502 948 €
ENABLE MIDSTRM	2500000	2 240 855 €
ENAGAS FIN 1,375%28	500000	504 357 €
ENAGAS FIN 0,75%2026	2500000	2 400 781 €
ENAGAS FIN 1,25% 25	5100000	5 277 346 €
ENAGAS FIN 2,50% 22	3200000	3 603 850 €
ENBRIDGE I 4,25 26	3258000	3 164 716 €
ENBW 3,625% 14-2076	1300000	1 347 706 €
ENCANA C 3,9 1121	3000000	2 894 297 €
END FINANCE 2,95% 22	4500000	4 282 055 €
ENEL 5,25% 20/05/24	200	1 343 720 €
ENEL FI 5%09-22	5000	6 328 441 €
ENEL FIN 1,966% 2025	6808000	7 368 130 €
ENEL FIN INT1 PCT16	20870	21 133 945 €
ENEL INV,5,25%23	2060000	2 638 856 €
ENEL SPA 4,875% 18	3510000	3 849 721 €
ENEL SPA 5% 75	1300000	1 438 425 €
ENERGIE B 3,375 0477	4541000	4 583 331 €
ENERGY 6050 010641	2120000	2 072 714 €
ENERGY TRA 6,7% 18	1525	1 537 585 €
ENERGY TRAN 2,50% 18	2000000	1 903 084 €
ENERGY TRAN 4,75% 26	4600000	4 592 327 €
ENEXIS HOLD 0,875%26	6900000	6 894 646 €
ENEXIS HOLDG 1,50%23	7290000	7 759 827 €
ENI 0,625% 16-2024	20265000	19 690 975 €
ENI 4,25%12-03/02/20	4800000	5 581 237 €
ENI SPA 0,75% 22	9736000	9 881 552 €
ENI SPA 1,125% 2028	8000000	7 637 785 €
ENI SPA 1,50% 26	3200000	3 319 732 €
ENI SPA 2,625% 2021	3004000	3 324 719 €
ENI SPA 3,25% 2023	2500000	2 933 431 €
ENI SPA 3,625% 29	1200000	1 501 645 €
ENI SPA 4,125%09-19	43	2 407 916 €

ENI SPA 4,875 17	5000000	5 246 646 €
ENLINK MD4,40%04/ 24	5000000	4 753 443 €
ENTER PRODU 5,20% 20	8600	9 044 869 €
ENTERGY 5,59% 24	1000000	1 109 416 €
ENTERGY 4% 15-2022	3930000	3 946 763 €
ENTERGY CO 2,95 0926	475000	426 185 €
ENTERP PROD 3,75% 25	3300000	3 214 128 €
ENTERPRISE 5,25%2020	5230	5 479 781 €
ENTERPRISE PRODU	4000000	4 053 927 €
EOG RESOU 5,625 0619	1550000	1 595 795 €
EPENERGYA 4,37 18	4200000	4 438 700 €
EPENERGYA 5,87 19	2600000	2 962 227 €
EQUINIX 5,375% 23	3500000	3 479 741 €
ERAC USA 3,85% 2024	2300000	2 223 258 €
ERAC USA FINANCE	4400000	4 099 125 €
ERP OPERA 2,85 11/26	2450000	2 192 912 €
ERSTE GRP 1,875% 19	9700000	10 227 990 €
ERSTE GRP 7,125%2022	4000000	5 043 849 €
ESB FINANCE 2,125%27	2700000	2 947 560 €
ESSEX PORT 3,62 22	2000000	1 960 630 €
ESSEX PORT 3375 0426	3200000	2 951 221 €
ESSILOR 1,75% 090421	2500000	2 692 442 €
ETP 5,2% 2022	3000000	3 100 330 €
ETP 6,50% 2042	2490000	2 619 335 €
ETP 9% 15/04/2019	1222	1 335 459 €
EUROCLEAR 1,125 -26	9100000	9 142 417 €
EUROGRID 1,875 25	3900000	4 217 456 €
EUTELSAT 1,125% 21	5300000	5 444 578 €
EUTELSAT 3,125% 2022	500000	564 309 €
EUTELSAT SA 2,625%20	2000000	2 174 043 €
EVERYTH 3,25%2018	3700000	3 938 329 €
EVONIK FIN 0,75 0924	3000000	2 882 393 €
EVONIK FIN 0,75 0928	2350000	2 188 204 €
EVONIK IND 1 23	5100000	5 261 220 €
EXELON 2,85% 20	1100000	1 053 229 €
EXELON CORP 2,45% 21	105000	98 348 €
EXELON CORP 3,4% 26	700000	652 446 €
EXOR SPA 2,125% 22	3000000	3 147 810 €
EXOR SPA 2,5%10/24	4540000	4 777 408 €
EXPEDIA 2,50% 22	5100000	5 395 698 €
EXPERIAN F 2,37 17	1350000	1 287 193 €
EXPRESS 4,75% 2021	4000000	4 099 312 €
EXPRESS SCRIPTS 3%23	3000000	2 784 432 €
EXXON 2,222% 16-2021	3250000	3 096 932 €
EXXON MOBI3,043 0326	5435000	5 184 887 €
FAURECIA 3125 150622	350000	360 886 €
FAURECIA 3625 0623	2850000	2 961 756 €
FCA CAP IRE 1,25% 20	6323000	6 451 139 €
FCA CAPI 1,375% 20	7900000	8 147 716 €
FCA CAPI 1250 210121	900000	920 695 €
FCA CPTL IRE 1,25%18	9800000	9 996 626 €
FCE BANK 1,875% 21	11798000	12 468 320 €
FCE BANK 1,134% 2022	5040000	5 133 731 €
FCE BANK 1,528 1120	2740000	2 841 422 €
FCE BANK 1660 110221	1500000	1 578 131 €
FCE BANK PL 1615 523	3030000	3 138 387 €
FEDEX 2,625% 2018	2910000	653 538 €
FEDEX 3,25%16-2026	500000	472 409 €
FEDEX CORP 1% 23	2800000	2 856 556 €
FERMACA EN 6,375% 38	1825000	1 652 443 €
FERROVEMIS 2,5 24	1100000	1 206 470 €
FERROVIAL 0,375%2022	1500000	1 461 045 €
FGA CAPITAL 2% 19	5130000	5 354 772 €
FGA CAPITL 2,87% 18	2000000	2 109 875 €
FIAT INDFI 6,25 18	1370000	1 532 770 €
FIATCHRYS 6,625 18	2000000	2 242 726 €

FIDEL NTL 5% 03/22	1500000	1 483 386 €
FIDELI NATIO 2,25%21	2061000	1 919 309 €
FIDELITY 3,625% 2020	13000000	12 815 684 €
FIDELITY 3,875% 2024	2100000	2 032 763 €
FIDELITY 4,50% 2022	1305000	1 328 508 €
FIDELITY NATL 3,5%23	1550000	1 496 505 €
FINM,5,75%18 EMTN	1500	1 655 214 €
FIRST AMERIC 4,60%14	2900000	2 728 705 €
FIRST RP BK 2,375%19	905000	854 563 €
FLA GAS 5,45%0720	1000000	1 029 529 €
FLEXTRONICS 5%2023	6000000	6 164 083 €
FLORIDA PW 3,125% 25	2000000	1 913 461 €
FON REG 1,75% 09/21	8500000	8 869 574 €
FONTERRA 0750 081124	3100000	3 044 481 €
FORD MOTOR 2,375%18	1800000	1 731 412 €
FORD MOTOR 2,943%19	4390000	4 264 761 €
FORD MOTOR 2021 519	8000000	7 528 613 €
FORD MOTOR 3,33 21	2500000	2 404 540 €
FORD MOTOR 3096 0523	6675000	6 126 736 €
FORD MOTOR 4,25% 22	1325000	1 310 724 €
FORD MOTOR 4,375%23	1135000	1 127 497 €
FORD MOTOR 4,389% 26	4100000	4 013 391 €
FORD MOTOR 5%18	976000	966 621 €
FORD MOTOR 5,875%21	2000000	2 139 159 €
FORTIS BK 4,375%17	1000	1 043 683 €
FORTIS INC 2,10% 21	1925000	1 767 803 €
FORTIVE 2,35%16-2021	2100000	1 961 438 €
FRA,TEL,5 5/8%18	900	1 002 201 €
FRA,TELEC,8 1/8%33	1194000	2 300 150 €
FRONTIER CO 8,5% 20	3000000	3 022 950 €
FRTEL 4,125% 2019	1100000	1 236 445 €
FTB MEMPHI 2,95 19	1925000	1 831 275 €
G4S INTL 1,50% 01/23	2205000	2 215 312 €
GAI BOND IS 3,4 926	2042000	1 845 519 €
GALP GAS 1,375% 2023	3900000	3 868 876 €
GAS FENOSA 2,875% 24	3700000	4 287 597 €
GAS NAT 4,125 18	69	3 731 870 €
GAS NAT 5,375 19	30	3 477 919 €
GAS NAT 6,375 19	800000	950 536 €
GAS NAT FE 4,125% 22	2600000	2 654 544 €
GAS NAT FEN, 1,25%21	5300000	5 364 559 €
GAS NAT FENO 3,5% 21	6000000	6 957 512 €
GAS NATURAL 6% 20	3000000	3 703 558 €
GAS NET 1375 051226	1550000	1 568 633 €
GDF SUEZ 0,5 130322	7000000	7 092 693 €
GDF SUEZ 1,5% 2017	5300000	5 385 028 €
GDF SUEZ 3% 2049	17400000	18 369 984 €
GE 4,65% 2021	5000	5 238 327 €
GE CAP 2,25% 20	1900000	2 066 443 €
GE CAP 2,625% 2023	1900000	2 193 386 €
GE CAP EUR FD 0,8%22	18710000	19 341 392 €
GE CAPIT2,342% 20	7000000	6 639 383 €
GE CAPITAL EUR FUND	120	7 088 880 €
GE EUR FUND 5,375%20	1200	1 458 048 €
GECINA 1% 30/01/29	2400000	2 242 508 €
GECINA 1,5% 2025	1600000	1 675 620 €
GECINA 2% 24	1400000	1 521 616 €
GELF BOND 1,75% 21	3440000	3 575 136 €
GELF BOND 0,875% 22	4499000	4 441 673 €
GEN ELECT 1,875 % 27	1000000	1 094 152 €
GEN ELECTRI 1,25% 23	16260000	17 138 901 €
GEN ELECTRIC 2,7%22	6325000	6 020 429 €
GEN ELECTRIC 5%2021	3822000	3 770 211 €
GEN MOT 2,35% 19	2400000	2 258 127 €
GEN MOT FI 0,85 18	4600000	4 669 119 €
GEN MOTORS 3,2% 20	9000000	8 660 043 €

GEN MOTORS 3,10% 19	1520000	1 476 203 €
GEN MOTORS 3,2% 21	1955000	1 861 712 €
GEN MOTORS 3,7 0523	2200000	2 061 535 €
GEN MOTORS F 1 0520	2600000	2 660 322 €
GEN MOTORS FIN	2200000	2 155 581 €
GENERAL EL,5,25%17	6000	5 916 544 €
GENERALI FI 5,479%49	10050000	10 546 277 €
GENMOTFIN 4,375% 21	5965000	5 907 501 €
GENMOTFIN 5,25%2026	8500000	8 578 519 €
GILEAD 2,35%02/20	1650000	1 585 600 €
GILEAD SCIE 2,5 0923	1720000	1 583 561 €
GILEAD SCIE 3,25% 22	3455000	3 376 694 €
GILEAD SCIE 3,65% 26	1730000	1 678 797 €
GILEAD SCIENCES	3000000	2 943 032 €
GLENC FIN 1,625% 22	2570000	2 618 712 €
GLENCORE 1,25% 2021	1860000	1 879 158 €
GLENCORE 4,125% 18	8194000	8 895 619 €
GLENCORE 5,25% 03/17	90	4 733 014 €
GLENCORE FI 1,75% 25	3976000	3 843 053 €
GLENCORE FI 3,375%20	9000000	9 874 208 €
GN FENOSA 3,875%2022	2000000	2 396 245 €
GNL QUINTE 4,634% 29	1425000	1 357 100 €
GOLD SACHS 2,35% 21	2050000	1 900 435 €
GOLD SACHS 2,75% 20	2350000	2 251 639 €
GOLD SACHS 4,25% 25	10305000	9 995 153 €
GOLDCORP 3,70%13-23	1700000	1 603 239 €
GOLDM SACH 3,75 0226	755000	726 312 €
GOLDMAN 2,875% 2026	2500000	2 812 628 €
GOLDMAN 1,625% 2026	17163000	17 129 328 €
GOLDMAN 2,125% 24	5500000	5 840 478 €
GOLDMAN 2,625% 2019	12720000	12 317 110 €
GOLDMAN 2,625% 21	950000	897 305 €
GOLDMAN 2300 131219	3500000	3 318 042 €
GOLDMAN 4,375%10-17	50	2 609 650 €
GOLDMAN 5,125% 10/19	228	13 107 384 €
GOLDMAN 5,75%12-2022	3090000	3 363 172 €
GOLDMAN 6,375%18	1100	1 240 260 €
GOLDMAN S,1,25% 2025	3773000	3 721 753 €
GOLDMAN SACH 2,55%19	3205000	3 071 817 €
GOLDMAN SACHS 4% 24	7800000	7 736 369 €
GOLDMANSACHS5,25% 21	4000	4 238 357 €
GOODMAN FD 6,37 20	2400000	2 566 801 €
GOODYEAR 5,125% 2023	3000000	2 939 411 €
GREAT 5,292%2022	1200000	1 227 521 €
GREAT-WEST 1,75 -26	2515000	2 549 222 €
GREAT-WEST 2,5%2023	12571000	13 959 340 €
GROUPE FNAC 3,25% 23	7900000	8 185 714 €
GSACHS G 0,75 19	4400000	4 490 033 €
GSACHS G 2% 16-2019	2300000	2 180 151 €
GSACHS G 2,50% 21	3200000	3 501 013 €
GSACHS G 2,625% 2020	14321000	15 620 676 €
GSACHS G 2,875% 21	5000000	4 801 431 €
GSACHS G 3,25% 23	13600000	15 774 068 €
GSACHS G 7,5 19	4000000	4 309 710 €
HAMMERSON 2% 22	2250000	2 347 400 €
HANNOVER 3,375% 49	3800000	3 955 481 €
HANNOVER 5,75%2040	29	1 683 941 €
HANNOVER FIN,5%2043	1000000	1 186 093 €
HANOVER 4,5% 26	2100000	2 014 646 €
HARMAN INTE 4,15 025	2400000	2 361 873 €
HARRIS C 4854 270435	1250000	1 256 019 €
HCA INC 3,75%14-2019	3500000	3 428 982 €
HCA INC 4,50 27	975000	919 176 €
HCA INC 4,75%12-2023	3900000	3 812 606 €
HCA INC 5250 150626	828000	808 466 €
HDLBRG LUX 2,25 19	1500000	1 593 959 €

HEAL REALTY 3,875%2	1300000	1 218 443 €
HEALTH CARE 4,50%24	2000000	2 039 668 €
HEALTHCARE 3,5%26	1550000	1 420 547 €
HEATHROW 1,875% 2022	6200000	6 726 240 €
HEATHROW FNDG 1,5%30	4940000	4 890 267 €
HEIDE 7500 0420	3000000	3 740 678 €
HEIDEBGCMET 2,25%24	2050000	2 214 367 €
HEIDELB 1500 070225	1400000	1 412 650 €
HEIDELBER 2,25 0323	5854000	6 362 562 €
HEIDELCEM 8,5% 19	1500000	1 869 627 €
HEINEKEN 1% 16-2026	27600000	27 437 172 €
HEINEKEN 1,25 21	6000000	6 275 696 €
HEINEKEN 2,875%2025	3200000	3 732 160 €
HEINEKEN NV 1,50% 24	5000000	5 248 298 €
HEINEKEN NV 2% 21	7700000	8 384 040 €
HEMSO FASTIGHET 1%26	2600000	2 511 019 €
HENKEL AG & CO 0%18	3675000	3 681 112 €
HERA SPA 0875% 26	2950000	2 812 830 €
HERA SPA 2,375% 24	4200000	4 676 690 €
HESS CO 3500 150724	1800000	1 602 854 €
HILCORP EN 5,75 1025	2250000	2 194 566 €
HILDOC 4,25%16-2024	1214000	1 135 070 €
HLDG D'INFRA 2,25%25	2500000	2 769 131 €
HOIST KRED 3,125% 19	1850000	1 942 815 €
HOLCIM FIN 3% 2024	5140000	5 950 937 €
HOLCIM FIN, 2,25% 28	750000	794 793 €
HOME DEPOT 2 0619	6500000	6 218 931 €
HOME DEPOT 2%16-2021	1000000	943 439 €
HOME DEPOT 2,125% 26	1075000	944 699 €
HOME DEPOT 3%16-2026	2025000	1 921 659 €
HONEYWEL 0,65%2023	1600000	1 633 794 €
HONEYWEL IN 1,4 1019	3585000	3 377 183 €
HOSPIT PROP 4,5% 25	2678000	2 500 042 €
HOST H&R 6% 10/21	775000	826 806 €
HOST HOTELS 3,75%23	2950000	2 761 612 €
HOWARD HUGHES 3,5%23	3900000	3 892 182 €
HSBC 3,90 05/26	5100000	4 871 985 €
HSBC 4% 30/03/2022	2000000	1 982 983 €
HSBC 5,1% 05/04/2021	5000	5 186 110 €
HSBC 6,25%18 SUBD,	64	3 592 674 €
HSBC 6,375% 15-2049	6000000	5 758 879 €
HSBC FINCE 6,676% 21	7500	8 213 811 €
HSBC FRCE EUR3M 19	2800000	2 825 357 €
HSBC HO 4,375 231126	690000	659 851 €
HSBC HOL 0875 060924	17925000	17 619 684 €
HSBC HOLD 1,50% 22	11229000	11 842 803 €
HSBC HOLD 3,375% 24	7900000	8 533 429 €
HSBC HOLDG 4,25%2025	3375000	3 267 082 €
HSBC HOLDI 2,65 0122	4125000	3 836 475 €
HSBC USA 1,70% 2018	2630000	2 503 323 €
HSBC USA 2% 2018	2975000	2 842 524 €
HUGHES SATEL 6,5%19	3365000	3 492 106 €
HUMANA INC 3,15% 22	3320000	3 142 739 €
HUNTINGTON 2,2% 2018	5000000	4 769 261 €
HUNTINGTON 3,15 0321	2000000	1 936 653 €
HUSKY ENE 3950 0422	7000000	6 951 007 €
HWLTT PCKD 4,65% 21	3340	3 382 744 €
HYATT 4,85% 26	3300000	3 327 938 €
IBER INTL 2,50% 22	3200000	3 558 079 €
IBERDROLA 2,875% 20	7500000	8 283 436 €
IBERDROLA 1,125%2026	13500000	13 569 656 €
IBERDROLA 3% 22	10600000	12 224 832 €
IBERDROLA IN 3,5% 21	2000000	2 322 349 €
IBM 0,50 07/09/21	7200000	7 321 056 €
IBM 1,625 05/20	4975000	4 649 859 €
IBM 1,875%12-2022	5000000	4 568 385 €

IBM CO 1800 170519	1650000	1 569 452 €
IBM CORP 1,125% 24	8800000	9 117 919 €
ICADE 1,125% 171125	20600000	19 992 576 €
ICADE 1,75% 16-2026	6800000	6 951 315 €
ICADE 1,875% 09/2022	2500000	2 658 032 €
ICADE 2,25% 21	3300000	3 589 115 €
ICAHN EFL 4,875 19	2000000	1 941 438 €
IE2 HOLD 2875 010626	1500000	1 584 279 €
IE2 HOLDCO TF 23	4400000	4 598 820 €
ILLINOIS TOOL1,25%23	13300000	13 921 223 €
IMERYS 2,5% 13-2020	7700000	8 307 089 €
IMERYS SA 0,875%22	2000000	2 033 081 €
IMP TOBAC 3,375% 26	2060000	2 466 605 €
INBEV NV 4% 0418	3000	3 240 272 €
INFINEON TECH 1%2018	5560000	5 661 140 €
INFRA FOCH 1,25% 20	3900000	4 040 733 €
ING 0,75 22/02/21	3500000	3 597 721 €
ING 2,50 01/10/19	4400000	4 220 028 €
ING BANK 1,25% 2019	7650000	7 927 820 €
ING BANK 1,875% 2018	4300000	4 463 095 €
ING BANK 3%16-2028	8300000	8 931 121 €
ING BANK 3,625% 26	1500000	1 678 211 €
ING BANK 4,5% 2022	5000000	6 246 624 €
ING BANK NV 0 050617	2100000	2 105 640 €
ING BANK NV 3,50% 23	7000000	7 397 667 €
ING BANK TV290523	5700	6 360 335 €
ING BK 5,80% 23	2425000	2 556 030 €
ING US INC 2,9% 2018	3687000	3 572 476 €
ING VERZ,6 3/8%27	1280	13 509 536 €
INMOBILIARIA 1,45%24	25900000	24 722 515 €
INT LEASE 5,875%2019	13230000	13 502 568 €
INT PAPER 3,80% 2026	3900000	3 800 959 €
INTEL CO 3300 011021	1550000	1 538 224 €
INTEL CORP 2,60 26	3490000	3 198 234 €
INTEL CORP 2,7% 22	1600000	1 519 951 €
INTER EXCH 2,75%2020	4000000	3 821 369 €
INTERNATI FL1,75 324	4283000	4 551 119 €
INTESA 4%10-2018	38	4 073 150 €
INTESA 5% 0217	2100000	2 204 936 €
INTESA SA 4,375%2019	2000000	2 226 053 €
INTESA SAN 1,125% 22	6250000	6 323 354 €
INTESA SAN 3,875% 18	3400000	3 324 895 €
INTESA SAN 4% 23	6500000	7 680 348 €
INTESA SANP 2% 21	16640000	17 621 123 €
INTESA SANP 4,75% 24	4900000	4 810 341 €
INTESA SANPA 3% 19	8200000	8 843 186 €
INTESA SANPA 3,5% 22	4800000	5 524 303 €
INTESA SP 6,625%2018	27	1 493 818 €
INTL LS FIN 5,875 22	3250000	3 412 407 €
INTL PAPER 3%16-2027	1400000	1 262 582 €
INTPUB GRP 4,20% 24	1650000	1 615 151 €
INTPUBLICGRP 3,75 23	1249000	1 202 466 €
INVESTOR 4,875%21	850	1 046 610 €
IREN SPA 0,875 1124	12010000	11 484 040 €
IRON MOUNT 6% 0823	1625000	1 672 473 €
JAB HOLD 1,75% 23	14500000	15 233 993 €
JC DECAUX 1%16-2023	5500000	5 624 331 €
JJOHNSON 2,45% 26	4550000	4 143 461 €
JOHN DEERE 1,25%2019	3750000	3 504 567 €
JOHN DEERE 2,8 0323	5000000	4 744 326 €
JOHNSON&JO 065 0524	19595000	19 767 208 €
JOHNSON&JOHN 1,65%35	7000000	7 298 613 €
JOHNSON&JOHN 2,05%23	1075000	995 463 €
JOHSON CO 3,9 0426	1600000	1 584 006 €
JP MORGAN 4,5%12-22	13900000	14 432 872 €
JPM 4,625% 2021	7500	7 692 387 €

JPMORG CH 3625 1227	2657000	2 449 262 €
JPMORG CHASE 4,4%20	2260000	2 317 086 €
JPMORG CHASE 6% 0118	4000000	4 059 515 €
JPMORGAN 1,375% 21	8129000	8 554 350 €
JPMORGAN 1,5% 25	2120000	2 213 760 €
JPMORGAN 2,625% 21	19200000	21 457 266 €
JPMORGAN 0625 250124	21600000	21 172 743 €
JPMORGAN 1,5% 26	6500000	6 638 278 €
JPMORGAN 1,50% 2022	4100000	4 306 060 €
JPMORGAN 1,70% 2018	2975000	2 834 043 €
JPMORGAN 1,875%2019	6000000	6 336 589 €
JPMORGAN 2,295% 2021	5245000	4 916 507 €
JPMORGAN 2,55% 20	1700000	1 617 599 €
JPMORGAN 2,55%16-21	5000000	4 754 697 €
JPMORGAN 2,75% 0822	2800000	3 154 437 €
JPMORGAN 2,75% 23	1900000	2 174 521 €
JPMORGAN 2,95% 2026	9500000	8 628 880 €
JPMORGAN 3,20%2023	5000000	4 840 684 €
JPMORGAN 3,25% 22	4885000	4 724 282 €
JPMORGAN 3,875% 2024	4775000	4 615 502 €
JPMORGAN 6,75% 49	2000000	2 099 692 €
JPMORGAN C 3,125% 25	5125000	4 810 005 €
JPMORGAN CH 1,85 319	3625000	3 442 412 €
JPMORGAN Ch 4,95 320	4760000	4 919 035 €
JPMORGAN CH VAR1249	2100000	2 042 075 €
JPMORGAN CHASE TV 23	2100000	2 038 184 €
KAISER HOSP 3,5% 22	700000	689 633 €
KANSAS CITY SOUT	920000	862 566 €
KBC GROEP 2,375% 24	8700000	9 041 926 €
KBC GROEP 1%16-2021	6800000	7 017 859 €
KBC GROEP 1,875% 27	4900000	4 992 305 €
KBC GRP 0750 181023	8500000	8 400 386 €
KERING	5200000	5 226 174 €
KERING 0,875% 22	1500000	1 534 276 €
KERING 2,5%13-2020	2700000	2 953 822 €
KERR-MCGEE CORP	2400000	2 685 252 €
KEY BANK 1,65% 18	3300000	3 150 036 €
KEY BANK 1,60 08/19	2100000	1 974 709 €
KEY BK 3400 200526	5800000	5 339 794 €
KEYBANK NA 2,25% 20	9500000	9 011 850 €
KILROY RE 4,375 1025	2000000	1 964 871 €
KINDER MORG 1,50% 22	5000000	5 122 251 €
KINDER MORG 3,95%22	5000000	4 911 475 €
KINDER MORGA 4,30%25	7600000	7 415 475 €
KLA-TENCOR 4,65% 24	4000000	4 028 771 €
KLEPIERRE 1% 2023	6500000	6 682 328 €
KLEPIERRE 1,75% 24	2000000	2 123 331 €
KLEPIERRE 4% 10-2017	5900000	6 138 248 €
KON DSM 0,75% 2026	12700000	12 393 660 €
KONINKL 0625 090425	3000000	2 876 461 €
KONINKL 1125 110928	2500000	2 364 934 €
KPN NV 4,25% 22	3470000	4 231 277 €
KPN TF/TV PERP EUR	6985000	7 597 562 €
KRAFT FOODS 3,5% 22	2665000	2 574 089 €
KRAFT HEINZ 1,5%2024	2700000	2 749 170 €
KRAFT HEINZ 2,25% 28	2712000	2 806 091 €
KRAFT HEINZ 3,95% 25	3380000	3 305 599 €
KRAFT HZ 2% 07/18	7890000	7 482 066 €
KRAFT HZ 3% 01/06/26	5000000	4 449 648 €
KRAFT HZ 3,5% 150722	1280000	1 252 704 €
KROGER 3500 010226	1500000	1 449 560 €
KROGER CO/THE	3000000	2 988 308 €
LABORATORY 4% 2023	2800000	2 739 132 €
LAM RESEAR 2,75% 20	8000000	7 655 598 €
LAMAR MEDIA 5,375%23	5175000	5 214 898 €
LANXESS 0,25% 21	1600000	1 588 862 €

LANXESS 4,5% 23	2105000	2 197 140 €
LANXESS AG 1% 26	800000	763 283 €
LBP 2,75% 27	1500000	1 545 542 €
LEASE CORP 2,375% 19	510000	543 435 €
LEASEPLAN 1 240521	9200000	9 361 918 €
LEASEPLAN 1,375%2018	6000000	6 149 385 €
LEASEPLAN CORP	14200000	14 532 820 €
LEGRAND 1,875 27	1200000	1 299 642 €
LENNAR CP 4,50 19	3500000	3 443 290 €
LEXINGTON 4,40% 2024	1700000	1 584 509 €
LIBERTY MUTL 2,75%26	4200000	4 419 053 €
LIBERTY PR 3,75 0425	2000000	1 926 545 €
LIFEP HEALTH 5,5%21	3480000	3 424 552 €
LINCOLN NATL CRP	2758000	2 608 133 €
LINDE FINANCE 1%2028	2850000	2 862 589 €
LLOYDS BANK 4,65% 26	3055000	2 965 836 €
LLOYDS BK 1,25% 25	2650000	2 766 740 €
LLOYDS BK 1% 091123	4318000	4 240 438 €
LLOYDS BK 1% 191121	10900000	11 267 262 €
LLOYDS BK 4,5% 24	2410000	2 337 763 €
LLOYDS TSB 6500 0320	2300	2 817 412 €
LLYODS 0,75 091121	5683000	5 659 502 €
LOWE'S C 2500 150426	1725000	1 552 485 €
LOWES CO 3,75% 15-21	4000000	4 034 371 €
LVMH MOET 1% 09/21	4000000	4 156 988 €
LYB INTL FI 4% 23	1600000	1 609 009 €
LYONDELLBA 5% 19	5400000	5 461 084 €
MACQ GROUP 6% 20	8000000	8 405 328 €
MACQUA BK 1% 19	6495000	6 676 383 €
MACQUARIE 6,625%2021	1200000	1 294 264 €
MACQUARIE BK 2,35%19	5600000	5 372 747 €
MACQUARIE BK 2,60%19	1400000	1 335 630 €
MACYSRETAIL 2,875%23	4900000	4 450 489 €
MAGNA INTL 1,90% 23	5100000	5 360 765 €
MANPOW 1,875 09/2022	5803000	6 090 168 €
MANUF&TRADER 2,10%20	2800000	2 657 263 €
MANULIFE FIN4,15% 26	4100000	4 081 958 €
MAPFRE 1,625% 26	4400000	4 446 256 €
MARATH PETRO 2,70%18	2950000	2 835 608 €
MARATHON OIL 2,8% 22	4000000	3 609 378 €
MARKEL 3,625%2023	4000000	3 835 661 €
MARRIOTT 3125 150626	1000000	899 574 €
MARRTTINTL 2,30 22	4155000	3 870 806 €
MARSH & MCL 3,75 326	1500000	1 468 347 €
MASCO CO 4,45 25	3500000	3 400 714 €
MASTERCARD 1,10 1222	6300000	6 492 807 €
MASTERCARD 3,375% 24	1370000	1 345 454 €
MAXIM 2,5% 11/18	5000000	4 800 011 €
MCDO CORP 1,75% 28	2200000	2 304 822 €
MCDONALD 3,375% 15	1500000	1 424 266 €
MCDONALDS 1% 11/23	3700000	3 750 138 €
MCDONALD'S 1,125%22	5700000	5 912 019 €
MCDONALD'S 2,75% 20	360000	346 206 €
MCDONALD'S 3,70%26	1270000	1 238 791 €
MCKESSON CORP	3000000	2 952 213 €
MEAD JOHNSON 3%15-20	2200000	2 114 162 €
MEDICOM 2,25% 19	2300000	2 428 756 €
MEDTRONIC 1,375% 18	3350000	3 181 477 €
MEDTRONIC 3,5% 25	5600000	5 499 624 €
MEDTRONIC 4,125%0321	2500000	2 540 991 €
MERCIALYS 1,787% 23	2300000	2 370 006 €
MERCK & CO 1,125% 21	8550000	8 936 095 €
MERCK & CO 2,35% 22	1375000	1 302 525 €
MERCK FIN 1,375% 22	3200000	3 387 296 €
MERCK FIN 4,5%10-20	900	1 061 864 €
MERCK NEW 2,80%2023	3500000	3 320 398 €

MERCK&CO 5%09-2019	3857	3 944 450 €
MERLIN EMTN1875 1126	1530000	1 466 953 €
MERLIN PROP,2,225%23	4016000	4 186 809 €
MERLINENTT 2,75% 22	1000000	1 045 540 €
MET LIFE 0,875% 22	10200000	10 484 334 €
MET LIFE 2,375% 19	14720000	15 753 384 €
MET LIFE 2,375% 2023	6006000	6 754 752 €
METLIFE 3% 03/25	1675000	1 568 780 €
METROPCS W 6,62 20	3500000	3 424 745 €
METROVACESA 2,375%22	12900000	13 579 715 €
MFINANCE 1,398%2020	2369000	2 384 024 €
MICHELIN LU 1,75% 27	4000000	4 324 472 €
MICROSFT 1,625 1218	3400000	3 242 432 €
MICROSFT 2 11/20	8000000	7 598 270 €
MICROSOFT 2 080823	3015000	2 750 294 €
MICROSOFT 2,375% 22	1765000	1 680 919 €
MICROSOFT 2,70% 2025	1345000	1 261 074 €
MICROSOFT 3,125% 28	6000000	7 388 172 €
MICROSOFT1550 080821	8800000	8 126 279 €
MICROSOFT2400 080826	5530000	4 986 988 €
MIDAM NRJ 3,50%2024	2000000	1 968 614 €
MITSUB FIN 2,95%2021	7350000	7 051 757 €
MOHAWK INDUS 2% 2022	3600000	3 869 708 €
MOLSON 1,25% 24	4765000	4 786 931 €
MOLSON C 2100 150721	4275000	3 982 542 €
MOLSON CO 1,45% 19	350000	329 071 €
MOLSON COORS	5362000	4 854 413 €
MONDELE INT 2,375%35	119000	116 815 €
MONDELEZ INT 1% 22	600000	615 032 €
MONDELEZ INTL 2% 21	4857000	4 431 565 €
MONDI 5,75% 2017	4917000	5 201 163 €
MONDI FINAN 3,375%20	2736000	3 052 276 €
MONDIALE 5,05% 25	5435000	5 439 066 €
MORG 5,375% 08/20	57	3 430 567 €
MORG STAN 0245 0219	6130000	5 909 155 €
MORGA STA 1,375 1026	6290000	6 148 600 €
MORGAN EURIB 122019	4710000	4 716 101 €
MORGAN 1% 12/2022	15431000	15 573 505 €
MORGAN 2,2% 2018	875000	833 431 €
MORGAN 2,375% 2019	2850000	2 736 101 €
MORGAN 5,50%021017	2100	2 217 655 €
MORGAN 6,25%17	3490	3 481 657 €
MORGAN C&C 2,87%2028	900000	1 058 034 €
MORGAN C&C 4,35 21	4000	4 111 066 €
MORGAN ST 2,5 0421	14700000	13 821 399 €
MORGAN STA 0,7 0122	9187000	9 194 560 €
MORGAN STA 4,875% 22	3260000	3 331 387 €
MORGAN STAN 1,75% 24	11850000	12 527 097 €
MORGAN STAN 1,75% 25	2040000	2 139 785 €
MORGAN STAN 1,875%18	2655000	2 519 399 €
MORGAN STAN 2,375%21	10700000	11 766 342 €
MORGAN STAN 3,70% 24	1158000	1 116 522 €
MORGAN STAN 7,3%19	4775	5 083 545 €
MORGAN STAN LIBUS 23	2100000	2 019 976 €
MORGAN STAN, 2,25%18	4450000	4 649 309 €
MORGAN STAN,3,125%26	4935000	4 523 538 €
MORGAN STAN,4,35% 26	1935000	1 896 121 €
MORGAN STAN,6,5%18	28	1 579 101 €
MORGAN STANL,5%19	4450000	5 111 256 €
MORGAN STLEY1,875%23	3200000	3 440 315 €
MOTABILITY 3,25% 18	1080000	1 148 806 €
MOTABILITY 3,75 17	2700	2 803 264 €
MOTIVA ENT 5,75 20	3000000	3 138 780 €
MOVIL SAB 2,125% 28	1100000	1 124 459 €
MPLX LP 4% 2025	2500000	2 335 946 €
MS 5,5%26/01/2020	11000	11 549 105 €

MUNC,RUCK,TV PERP,	340	17 901 680 €
MUNICH RE 6,25% 42	4800000	6 023 142 €
MYLAN 1250 231120	1990000	2 028 189 €
MYLAN 2250 221124	6096000	6 224 345 €
MYLAN 3,25%2021	3000000	2 797 516 €
MYLAN 3,95%16-2021	6925000	6 142 483 €
MYLAN INC 2,6% 18	2250000	2 138 101 €
MYLAN INC 4,20 1123	2000000	1 892 411 €
MYLAN NV	5000000	4 801 675 €
MYLAN NV 3,125% 28	3939000	4 020 800 €
NAB 4,625%10-20	3000	3 530 161 €
NAT 1,125% 03/06/22	16330000	16 874 885 €
NAT RURAL 1,65 19	2200000	2 093 097 €
NAT RURAL 5,45 17	6000	5 818 126 €
NATION BLDG 0,50% 19	6835000	6 902 156 €
NATIONAL 0,625% 24	11005000	10 807 447 €
NATIONAL RETAIL	4413000	4 117 824 €
NATIONWIDE 1,25% 25	1400000	1 435 325 €
NATIONWIDE 3,125%17	2000000	2 063 529 €
NATIONWIDE 3,90%2025	3000000	2 950 443 €
NATL AUST 0,625 1123	4725000	4 724 198 €
NATL AUSTR 2% 20	8770000	9 429 102 €
NATL GRID NA 1,75%18	2000000	2 070 454 €
NATWIDE B 4,125%2023	11995000	12 842 907 €
NCB CLEVE 5,8 17	700000	677 708 €
NEDERLANDSE G 0 1119	3550000	3 555 148 €
NESTLE FIN 1,5% 19	2700000	2 836 352 €
NETAPP INC 2% 17	1325000	1 258 045 €
NEUBERGER 5,875%2022	4000000	3 991 738 €
NEWELL RUBB 3,83 423	4140000	4 089 848 €
NEWELL RUBB 3,9 1125	3400000	3 286 801 €
NEWELL RUBBE 2,6 319	850000	818 807 €
NEWELL RUBBE4,2 0426	810000	807 486 €
NEWELL RUBBER TV21	6000000	5 829 429 €
NEWF EXPL 5,375% 26	2000000	1 934 330 €
NEWS AMER 3%2022	8248000	7 869 180 €
NGNA 0,75 02/22	5400000	5 509 921 €
NISOURCE 6,80% 2019	850000	904 236 €
NISOURCE FI 3,85% 23	1800000	1 777 870 €
NN GROUP 1% 2022	9296000	9 550 349 €
NOBLE ENERG 3,9% 24	2738000	2 628 342 €
NOBLE ENRGY 5,625%21	3000000	2 973 491 €
NOMURA EUR 1,125%20	4400000	4 524 453 €
NOMURA EUR 1,50% 21	8300000	8 683 167 €
NORDEA B 1 0926	550000	546 386 €
NORDEA BANK 1,375%18	6000000	6 172 174 €
NORDEA BANK 2% 2021	7031000	7 680 918 €
NORDEA BANK AB	9200000	9 559 432 €
NORDEA BK 1,125%2025	2500000	2 598 383 €
NORDEA BK 1,875%25	3500000	3 618 201 €
NORDEA BK 2,5%20	8300000	7 898 043 €
NORFOLK 5,75%18 SR	2500000	2 523 403 €
NOVALIS OF 3% 2022	1000000	1 034 540 €
NOVARTIS 0,125% 23	10815000	10 652 494 €
NVIDIA COR 2,20 0921	815000	758 339 €
NVIDIA CORP 3,20% 26	950000	871 198 €
NXP BV FDG 4,625% 23	3417000	3 411 713 €
NYKREDIT 0,75% 21	4000000	4 044 829 €
NYKREDIT 0875 130619	4991000	5 104 404 €
NYKREDIT 2,75% 27	5000000	5 123 259 €
OAT 0% 25/10/2023	330000	326 990 €
OAT 3% 25/04/22	715616461	851 793 136 €
OAT 3,50% 25/04/20	1679660699	1 945 505 257 €
OAT 4,25%07-23	633341000	819 132 016 €
OAT ZCP 04/24	176110002	172 908 322 €
OAT ZCP 25/04/2021	9831119	9 963 053 €

OAT ZCP 25/04/2022	9831119	9 896 398 €
OAT ZCP 25/04/2023	9879118	9 830 216 €
OCCID PETROL 3% 27	1395000	1 282 968 €
OCCIDENTAL 3,5%15-25	1600000	1 536 947 €
OMEGA HE 4500 150125	4800000	4 555 529 €
OMNICOM 4,45% 2020	1200	1 227 072 €
OMNICOM GP 3,6%26	5260000	4 972 352 €
OMNICOM GRP 3,65% 24	4300000	4 116 621 €
ONCOR 2,95%15-25	2550000	2 404 779 €
ONCOR ELEC 7% 09/22	1635000	1 922 024 €
ONEOK PART 3,8% 20	4000000	3 971 979 €
ONTEX GROU 4,75 21	1000000	1 061 073 €
OPTUS FINAN 3,5% 20	6000000	6 776 617 €
ORACLE 3,125% 25	3200000	3 846 990 €
ORACLE 1,20 10/17	3450000	3 278 397 €
ORACLE 2,25 10/19	3400000	3 274 468 €
ORACLE 2,4% 23	2550000	2 363 592 €
ORACLE 2,80 07/21	5000000	4 885 265 €
ORACLE 3,875%2020	5000000	5 103 004 €
ORACLE CORP	7540000	6 857 327 €
ORACLE CORP 1,9% 21	5650000	5 272 214 €
ORACLE CORP 2,5% 22	3000000	2 818 494 €
ORANGE 0,875%16-2027	10400000	10 100 852 €
ORANGE 1% 052025	9100000	9 172 627 €
ORANGE 1,875% 18	5200000	5 398 553 €
ORANGE 1625 031119	7900000	7 395 169 €
ORANGE 2,75% 2019	6125000	5 947 257 €
ORANGE 4,25% 20	5000000	5 481 866 €
ORANGE 5% 29/10/49	6900000	7 339 542 €
ORANGE 5,25% 2024	1070000	1 219 002 €
O'REILLY AUTO3,55%26	3000000	2 849 530 €
ORIGIN ENER 2,50%20	1300000	1 384 821 €
PACKAGG CORP 4,5% 23	1300000	1 316 257 €
PARTNERRE 1,25% 2026	3405000	3 288 832 €
PASO NATL 8,625% 22	875	1 047 635 €
PEMEX 3,75% 03/19	710000	769 120 €
PENSKE TRUCK 3,20%20	9165000	8 872 964 €
PENSKE TRUCK 4,25%23	1000000	1 000 913 €
PENTAIRFI 1,875 0917	700000	668 130 €
PEPSI INC 3% 2021	4500000	4 421 384 €
PEPSICO 0,875% 2028	8900000	8 686 337 €
PEPSICO 3,60% 2024	1575000	1 574 253 €
PEPSICO IN 1,35 1019	2150000	2 024 002 €
PERNOD 1,5% 26	1500000	1 541 329 €
PERNOD RIC 1,875% 23	5900000	6 353 240 €
PERRIGO FI 3,50% 21	7000000	6 768 477 €
PETRO-CANADA 6,05%18	2445000	2 464 177 €
PETROLEOS MXC 6,5 27	5800000	5 661 604 €
PFIZER 3 15/12/26	4125000	3 859 868 €
PHILIP INT 1,75%2020	4200000	4 479 175 €
PHILIP INT 1,87 21	2475000	2 307 765 €
PHILIP MOR 2,875% 29	10600000	12 403 111 €
PHILIPPS 66 4,3% 22	1300000	1 334 865 €
PHILIPS 3,75% 03/22	25000	24 981 €
PHILLIPS 3,605% 25	2200000	2 070 471 €
PIONEER N 6,875% 18	2280000	2 322 524 €
PIONEER NAT 3,45% 21	875000	860 616 €
PLAINS ALL 2,6%19	2925000	2 778 201 €
PLAINS ALL 3,60% 24	4000000	3 666 082 €
PLAINS ALL 4,35%25	750000	738 348 €
PLAINS PIPEL 3,65%22	8000000	7 656 315 €
PNC BANK 1,80%2018	4800000	4 567 589 €
PNC BANK N 2,45%20	4000000	3 803 227 €
PNC BANK NA	4000000	3 737 303 €
PNC FUND 3,3% 03/22	2000000	1 962 048 €
PNC FUNDI 5,125%0220	2500000	2 610 470 €

PNC PITTSB 1,95 19	4600000	4 390 331 €
PNC PITTSB 2,15% 25	5200000	4 872 750 €
POHJOLA BK 0,75%22	7050000	7 240 849 €
POHJOLA BK 0875 0621	10000000	10 337 433 €
POSTE ITAL 3,25%18	6744000	7 163 606 €
PPG INDS 0,875 22	3900000	4 008 873 €
PPG INDUS 0% 19	2921000	2 924 067 €
PPL CAPITAL 3,95% 24	875000	865 882 €
PPR 3,125% 23/04/19	5250000	5 739 881 €
PRECISION 3250 0625	3285000	3 133 903 €
PRICEL GRP 2,375% 24	5000000	5 284 840 €
PRICOA GLOB 1,6% 18	1500000	1 422 835 €
PRICOA GLOB 2,55% 20	5700000	5 411 767 €
PRO & GAMBLE 2,45%26	1400000	1 273 186 €
PROCTER 4 7/8%27	2570	3 621 210 €
PROG EN 3,15% 04/22	2665000	2 568 292 €
PROGRE CP 3,75% 21	3000000	3 039 479 €
PROGRS NR 4,875% 19	1965	2 004 820 €
PROLINTL2 1,87 25	1500000	1 554 832 €
PROLINTLII 2,875% 22	1630000	1 828 146 €
PROLOGIS 1,375% 0521	6985000	7 298 465 €
PROLOGIS 1,375% 20	8853000	9 186 071 €
PROLOGIS 3% 01/22	14436000	16 459 006 €
PROLOGIS 3,375% 24	2500000	2 956 990 €
PROSEGUR 2,75% 02/18	6000000	6 319 450 €
PRUD 4,50% 2021	3000	3 083 209 €
PRUDENT 7,575% 2019	1000	1 068 725 €
PRUDENT FI 3,50 24	1000000	966 059 €
PRUDENT FI 4,5% 2020	5350	5 443 381 €
PRUDENT FI 4,60% 44	2000000	1 974 911 €
PS COLOR 2,25%2022	1000000	935 933 €
PS COLOR 3,20% 20	1000	980 066 €
PSE&G 3 15/05/25	2000000	1 892 366 €
PTN RE FIN 5,5 20	4325000	4 456 521 €
PUBLICIS 1,125% 2021	3700000	3 819 323 €
PUBLICIS GRP 0,50%23	1500000	1 462 671 €
PUGET ENERGY INC	2000000	2 146 409 €
PUGET ENGY 6% 21	2000000	2 163 995 €
PULTEGROUP 5,5%26	1500000	1 445 723 €
PZU FIN 1,375% 19	2315000	2 349 409 €
QBE INSURA 2,40 18	8000000	7 636 969 €
QUEST DIAGNO 4,25%24	1400000	1 398 735 €
QVC 4,45% 15/02/2025	4000000	3 687 340 €
QVC 4,85% 14-2024	770000	727 413 €
QVC INC 4,375% 2023	1250000	1 179 294 €
RABOBANK 2,50% 2026	9500000	9 997 319 €
RABOBANK 3,75% 2020	11950	13 512 646 €
RABOBANK 3,875% 2023	1500000	1 748 844 €
RABOBANK 3,95% 22	5775000	5 647 123 €
RABOBANK 4% 01/22	9765000	11 940 183 €
RABOBANK 4,625% 23	2375000	2 374 793 €
RABOBANK 4,75%0622	16392	20 707 386 €
RABOBANK 5,5% 20	5650000	5 710 995 €
RABOBANK N 2,5 0121	7000000	6 698 881 €
RABOBANK NED NY	2100000	1 965 282 €
RABOBANK NL 1,25% 26	13700000	14 158 831 €
RABOBANK NL 3,875%22	2300000	2 327 569 €
RABOBK 5 7/8% 05/19	7960	9 318 853 €
RAYMOND J 3,625% 26	3760000	3 525 435 €
RBS GRP PLC 5,375%19	13650	15 701 096 €
RCI 1 17/05/23	3000000	3 018 942 €
RCI 2,25% 290321	3000000	3 262 055 €
RCI BANQUE 0,5%2023	12568000	12 132 568 €
RCI BANQUE 0,625% 20	8000000	8 102 721 €
RCI BANQUE 1,375% 20	7736000	8 015 719 €
RCI BANQUE E3M 0319	3400000	3 448 331 €

RCI Bq 0,625 1121	16890000	16 896 529 €
RCI BQUE 1,25% 22	2670000	2 749 648 €
REALTY IN, 3,875% 24	1555000	1 523 950 €
REALTY INCOME	350000	312 791 €
RED EL 2,125% 2023	9700000	10 736 918 €
RED ELECTRI 1 0426	800000	800 521 €
REDEXIS GAS 2,75%21	4000000	4 433 344 €
REGIONS FINL 2,25%18	4630000	4 432 322 €
REGLP FIN 5% 2022	5160000	5 243 487 €
REGLP FIN 5,875% 22	1140000	1 208 553 €
RELX CAPI 1,30% 25	5850000	6 014 589 €
RELX FINANC 1375 526	5684000	5 835 692 €
RENFINANCE 4,75%2020	4300000	4 987 660 €
REPSOL 2,625% 2020	2500000	2 736 027 €
REPSOL INTL 2,25% 26	3300000	3 492 589 €
REYNOLDS 4% 22	8990000	8 924 588 €
REYNOLDS 4,45% 25	1000000	1 000 989 €
REYNOLDS 8,125% 2019	1000000	1 084 426 €
REYNOLDS A 4,85% 23	1000000	1 041 516 €
REYNOLDS AMERICA	2000000	2 173 202 €
RIO TINTO 2875 0822	30000	28 837 €
RIO TINTO 3,75% 25	192000	187 282 €
RIO TNNT0 9% 2019	165	182 985 €
ROCHE FINA 0,50 23	4000000	4 075 127 €
ROPER IND 3,125% 22	2000000	1 891 558 €
ROPER TE 2800 151221	515000	487 342 €
ROPER TECH 3% 2020	3000000	2 878 796 €
ROYA BK CA 4,65 0126	3270000	3 346 044 €
ROYAL BK 3,875% 2023	13525000	12 382 517 €
ROYAL BK 4800 050426	2000000	1 915 980 €
ROYAL BK SC 250 0323	2500000	2 594 505 €
RTE 1% 26	1400000	1 392 552 €
RWE 5,75%33 EMTN	1810	2 640 877 €
RWE 6,5%08-21	3000	3 924 946 €
RWE FINANCE 1,875%20	5000000	5 343 905 €
RYANAIR 1,125% 23	5162000	5 218 248 €
RYANAIR 1,875% 21	2613000	2 779 930 €
RYDER SYSTEM 2,35%19	2000000	1 918 579 €
RYLAND 6,625%2020	3000000	3 138 368 €
S AND P GLOBA 2,5%18	1600000	1 546 061 €
SALLY HC 5,625% 25	1900000	1 882 225 €
SAMPO OYJ 1 0923	29740000	29 662 074 €
SAMPO OYJ 1,50% 2021	3100000	3 250 944 €
SANEF 0,95% 1028	3900000	3 732 839 €
SANOFI	13700000	12 839 654 €
SANOFI 0% 2022	5700000	5 558 528 €
SANOFI 0,625% 24	800000	801 034 €
SANOFI 1,125% 28	2300000	2 286 314 €
SANOFI 1,75% 14-2026	200000	213 974 €
SANPAOLO 5,35% 18	14600000	15 975 420 €
SANTAN CONS 0,90% 20	3900000	3 986 877 €
SANTAN CONS 075 0419	2500000	2 542 536 €
SANTAN CONS 1 0521	5700000	5 808 673 €
SANTAN CONS 1,10% 18	9800000	10 004 410 €
SANTAN CONS 1,5%2020	16000000	16 615 158 €
SANTAND IS 3,25% 26	3900000	4 072 409 €
SANTAND ISSU 2,5% 25	2000000	2 004 310 €
SANTAND UK 5 23	5965000	5 803 068 €
SANTANDE HLD 3,45%18	1700000	1 654 430 €
SANTANDER 0,25%2019	900000	901 279 €
SANTANDER 2,875% 20	3300000	3 122 349 €
SANTANDER BK 2% 2018	2000000	1 908 018 €
SANTANDER INTL	10200000	10 616 810 €
SANTANDER INTL 4%20	7000000	8 056 935 €
SANTANDER UK 2,50%19	1500000	1 438 348 €
SANTANDEU 1,125 0923	5700000	5 681 820 €

SAPPI PAP HOLD 4% 23	1100000	1 172 569 €
SAPRR 4,875% 01/19	4700000	5 383 382 €
SAPRR Eurib3 19	3700000	3 735 475 €
SCA AB 0,50 03/20	3200000	3 233 518 €
SCENTRE MG 1,5% 20	6967000	7 300 546 €
SCENTRE MGM 1375 323	2306000	2 415 591 €
SCHAEFFLFI 2,50 20	1500000	1 542 830 €
SCHAEFFLFI 3,25% 25	5868000	6 308 736 €
SCHLMB NOR 4,20 21	2303000	2 357 201 €
SCHNEIDER EL 2,5%21	4600000	5 127 419 €
SCOR 3%15-2046	7100000	7 221 084 €
SCOR SE 3,625 0548	4100000	4 285 195 €
SCRIPPS NET,3,50%22	4100000	3 922 917 €
SELECT INCOM 2,85%18	1872000	1 800 176 €
SELECT INCOM 4,15%22	2641000	2 515 135 €
SELP FIN 1250 251023	2498000	2 445 096 €
SEMPRA 9,8% 15/02/19	815	923 773 €
SERVICE COR 5,375%24	2750000	2 724 489 €
SES 4,625%16-2022	6371000	6 438 767 €
SES 5,625% 49	6373000	6 550 419 €
SES GLOBA 1,875% 18	2900000	3 008 061 €
SES GLOBAL GP 2,5%19	3000000	2 845 568 €
SG 2,5% 2026	9100000	9 386 941 €
SG 0,75%15-2020	2800000	2 864 042 €
SG 0750 26/05/23	6400000	6 470 303 €
SG 2,625% 27/02/25	2800000	2 935 861 €
SGSP AUSTR 2 22	6000000	6 412 799 €
SHELL 2,5% 240326	800000	926 427 €
SHELL IN 0,375% 25	2000000	1 932 295 €
SHELL INTF 1,875% 21	3000000	2 783 848 €
SHELL INTL 0,75%2028	5000000	4 732 706 €
SHELL INTL 1%14-2022	2330000	2 429 747 €
SHELL INTL 1,625% 27	3170000	3 395 585 €
SHELL INTL FIN	1435000	1 347 901 €
SHELL INTL2,125% 20	3275000	3 103 907 €
SHIRE ACQ 1,90% 2019	3475000	3 266 956 €
SHIRE ACQ 2,875%2023	1390000	1 259 699 €
SHIRE ACQ IN 2,4 921	10145000	9 344 173 €
SHIRE ACQ IN 3,2 926	3991000	3 559 100 €
SIEMENS FIN,2,35% 26	1950000	1 713 117 €
SIGMA ALI 5,625% 18	3825000	3 802 103 €
SIMON INTL 1,375% 22	7200000	7 488 708 €
SIMON PROP 2,50% 21	8000000	7 673 747 €
SKANDINAV 2% 2021	4200000	4 585 659 €
SKANDINAV 2,5% 2026	5000000	5 340 295 €
SKANDINAV 2,625%2021	7000000	6 679 721 €
SKANDINAV ENSKIL	6000000	5 711 403 €
SKF 2,375% 2020	8200000	8 804 161 €
SKY PL 2,875% 11/20	3500000	3 295 908 €
SKY PLC 2,25% 25	1140000	1 216 472 €
SKY PLC 2,50 09/26	3500000	3 797 424 €
SLB 0,625% 19	5930000	6 046 815 €
SMBC 2,25 07/19	6600000	6 308 311 €
SMURFIT AC 4,12 20	1500000	1 675 172 €
SNAM 0,875% 16-2026	14230000	13 632 987 €
SNAM 0000 251020	10112000	10 019 446 €
SNAM 1,375% 15-2023	1028000	1 065 510 €
SNAM 3,375% 21	1400000	1 615 729 €
SNAP ON 4,25% 2018	700	692 268 €
SNS BANK TV051125	4000000	4 208 025 €
SO GEN 0750 0221	2500000	2 565 138 €
SOC GEN 2,375% 02/18	4300000	4 509 051 €
SOC GEN 4% 23	2800000	3 246 776 €
SOCIET GE 0,125 1021	3100000	3 078 846 €
SOCIETE GENERALE	12300000	12 348 968 €
SODEXO 0750 14042027	7650000	7 400 969 €

SODEXO 1,75% 14-2022	4000000	4 334 561 €
SOGECAP 4,125% 99	2000000	2 054 427 €
SOLVAY FI 4,199% 49	8000000	8 562 398 €
SOLVAY FIN 4,45% 25	2200000	2 155 167 €
SOUTHER CO 1,85 0719	2725000	2 568 245 €
SOUTHER CO 2,95 0723	1675000	1 562 800 €
SOUTHERN 1,55% 2018	650000	613 808 €
SOUTHERN C 3,25 0726	1675000	1 542 923 €
SOUTHERN P 1,95 1219	2700000	2 540 097 €
SOUTHERNCO 2,15% 19	2050000	1 952 676 €
SP GLOBAL 3,30%2020	6000000	5 862 877 €
SPCM 2,875 06/23	2000000	1 999 155 €
SPECTRA PA 3,50 25	3100000	2 889 192 €
SPECTRA PARTNERS	1235000	1 121 157 €
SPI ELECT 2,375% 20	2960000	3 215 144 €
SPIRT AERO 3,85 26	4140000	3 849 774 €
SPRINT SPECT 3,36%21	5000000	4 753 164 €
ST FONCIERE 1,875%21	6000000	6 311 255 €
STANCORP FI 5 08/22	5250000	5 312 738 €
STAND CHART 4,05% 26	2800000	2 657 803 €
STANDARD 5,875%17	140	7 404 845 €
STANDARD C 3,625% 22	2018000	2 160 408 €
STANDARD CH 2,1 0819	3875000	3 658 738 €
STANDARD CHART 4%25	3000000	3 126 474 €
STARBUCK 2100 040221	3325000	3 162 047 €
STARBUCKS 3,85%23	4500000	4 578 898 €
STATE STREET 1,95%21	3350000	3 110 019 €
STATE STREET 3,55%25	1500000	1 467 177 €
STATOIL 2,875% 25	4000000	4 712 718 €
STATSTREET 4,95% 18	2000	1 985 595 €
STE AUTO 1,875% 25	9100000	9 889 438 €
STE AUTO 2,25% 20	4600000	4 987 891 €
STE FONCIERE 2,25%22	3900000	4 178 033 €
STE FONCIERE 3,50%17	2200000	2 276 477 €
STE GLE 6,999%2017	152	7 998 288 €
STEELRIVTC 4,71 17	500	320 074 €
STORA ENS 2,125 0623	1250000	1 279 965 €
STRYKER CO 3,37 24	2000000	1 910 021 €
STRYKER CORP 3,5% 26	3400000	3 267 754 €
SUEDZUCKER 1,25 23	2750000	2 811 156 €
SUEZ ENVIRON 3% 2020	2700000	2 837 049 €
SUMIT MITSU 2,058%21	5400000	4 990 964 €
SUMITOMO 2,25%20	4789000	5 188 830 €
SUMITOMO MITSUI 1%22	3390000	3 515 877 €
SUNOCO LOG 4,25% 24	1675000	1 618 302 €
SUNTRUST BK 3,30% 26	3800000	3 494 103 €
SVB FINANC, 5,375%20	3500	3 639 448 €
SVENSKA 2,25% 2020	5370000	5 838 423 €
SVENSKA 2,656% 24	2800000	2 989 492 €
SVENSKA HAND 2,4% 20	11400000	10 818 696 €
SVENSKA HND 1,875%21	5250000	4 833 364 €
SVENSKA HNDL 2,45%21	6300000	5 965 127 €
SVENSKA HNDLSBKN	31266000	32 511 063 €
SVK HANDBK 4,37 21	1600	1 933 208 €
SWEDBANK VRN 24	4200000	4 444 339 €
SWISS BV 2,6% 25	10800000	10 435 963 €
SWISS RE 1,375%23	7600000	7 834 241 €
SWISSCO 1,875% 2021	2700000	2 918 377 €
SWISSCOM AG 2% 2020	5800000	6 238 664 €
SYDNEY AIR 2,75% 22	11300000	12 644 531 €
SYNCHRON 4,25 24	6000000	5 848 956 €
SYNCHRONY FI 2,75%20	410000	391 050 €
SYNCHRONY FIN 2,6%19	8400000	8 085 485 €
SYSO 2,50% 16-2021	2790000	2 647 387 €
T MOBILE 6,25% 21	1055000	1 051 129 €
T MOBILE 6,375% 25	1155000	1 192 394 €

T MOBILE U 6,731% 22	1900000	1 934 775 €
TALANX AG 3,125% 23	8000000	9 520 873 €
TD AMERITR 3,62 25	2750000	2 655 449 €
TDC 1,75% 27	2040000	2 015 738 €
TDF 2,5% 07/04/26	4500000	4 673 707 €
TDF INFRA TF 22	1600000	1 734 928 €
TELECOM IT 6,125% 18	1500000	1 670 424 €
TELEF SAU 1,477% 21	11300000	11 766 452 €
TELEFON EM 3,987%23	300000	363 683 €
TELEFON TF/TV PERP	5200000	5 671 111 €
TELEFONIC 0,318% 20	9200000	9 146 998 €
TELEFONIC 1,93% 31	3100000	2 924 209 €
TELEFONICA 0,75%2022	10800000	10 824 235 €
TELEFONICA 1,46%2026	5100000	5 075 971 €
TELEFONICA 2,242% 22	6500000	7 065 569 €
TELEFONICA 2,932% 29	4200000	4 552 545 €
TELEFONICA 3,75% 22	9600000	9 473 197 €
TELEFONICA 3,961%21	4900000	5 737 744 €
TELEFONICA 4,71%20	8300000	9 761 158 €
TELEFONICA 8,25%30	1500	1 895 082 €
TELEKFIMA 3,125% 21	12753000	14 460 738 €
TELEKOM AUS 5,625%18	2000000	2 192 786 €
TELEKOM FIN 1,5%26	10800000	10 827 846 €
TELFON DEUT 2,375%21	11073000	12 189 705 €
TELSTRA 1,125 0426	6310000	6 434 810 €
TELSTRA 3,75% 2022	4400	5 310 117 €
TENNET 1,25% 33	3040000	2 856 822 €
TEO TVO 2,5% 03/21	1460000	1 535 197 €
TEOLL VOIM 2,625%23	3295000	3 329 945 €
TEREOS 4125 160623	1000000	1 049 946 €
TERNA 4,875%10/19	4000	4 573 415 €
TERNA SP 1000 111028	7324000	6 969 050 €
TERNA SPA 0,875% 22	8348000	8 560 389 €
TERNA SPA 2,875% 18	2925000	3 091 687 €
TESLTRA CO 3,125% 25	2000000	1 872 233 €
TESORO 5,125% 2024	470000	460 683 €
TESORO 5125 151226	2325000	2 230 436 €
TESORO C 5375 011022	1355000	1 349 109 €
TEVA FNC 1,25% 03/23	10985000	11 047 037 €
TEVA PH 2200 011021	14935000	13 660 370 €
TEVA PH 3150 011026	3425000	3 028 807 €
TEVA PHA FIN 3,65%21	1576000	1 518 020 €
TEVA PHARM 0,375% 20	9040000	8 975 467 €
TEVA PHARM 1,125% 24	2854000	2 760 322 €
TEVA PHARM 1,625%28	6913000	6 493 565 €
TEVA PHARMA 1,70%19	1590000	1 490 544 €
TEVA PHARMA 2,80% 23	2425000	2 187 743 €
THERMO FIS 2% 25	7303000	7 782 139 €
THERMO FISH 2,15% 18	1005000	957 410 €
THERMO FISH 2,95%26	2150000	1 927 053 €
THERMO FISH,1,375%28	1560000	1 487 771 €
THERMO FISH3,3%02/22	5250000	5 101 240 €
THERMO FISHE 0,75%24	7489000	7 264 337 €
THERMO FISHER 3% 23	2770000	2 600 600 €
THYSSENKR 3,125% 19	2000000	2 126 706 €
TIME WAR 3,6% 25	1695000	1 610 182 €
TIME WARN 6,75%2018	605	612 571 €
TIME WARNER7,57%24	750	894 242 €
TIME WARNR 2,95% 26	4000000	3 595 646 €
TIME WARNR 3,80 27	3310000	3 121 113 €
TIME WARNR 4 22	1300000	1 302 291 €
TIME WARNR 4,75% 21	3100000	3 182 020 €
TJX COS 2,25% 2026	5240000	4 605 946 €
TMCC 2 24/10/18	6575000	6 287 966 €
T-NOTE 0,875 19	3000000	2 820 980 €
TOBACC FIN 2,05 18	2225000	2 128 237 €

TOBACC FIN 2,25% 21	12558000	13 716 020 €
TOBACC FIN 4,50 18	1860	2 027 007 €
TOBACCO FIN 5%2019	8500000	9 738 278 €
TOLL B FIN 4,375 423	3500000	3 345 307 €
TORONTO 1450 060918	3500000	3 318 100 €
TORONTO BK 2,5% 20	4000000	3 807 000 €
TORONTO DO 3,625% 31	2875000	2 693 999 €
TOTAL CAP 2,875% 25	500000	591 041 €
TOTAL CAP 5,125% 24	1800000	2 460 994 €
TOTAL CAPI 0,75%28	9900000	9 532 964 €
TOTAL CAPIT 0,25% 23	5100000	5 044 304 €
TOTAL S,A, 2,708% 49	12793000	12 581 315 €
TOTAL S,A, 3,369%26	11161000	10 830 660 €
TOTAL SA 2,25% 49	25060000	25 442 842 €
TOTAL SA 2,625% 49	4630000	4 453 232 €
TOTAL SYSTE 3,8 0421	5225000	5 154 865 €
TOTALCAPI 2,125% 23	4300000	4 832 046 €
TOYOTA CRE 1% 09/21	2720000	2 826 362 €
TOYOTA MTR 1% 21	2000000	2 086 998 €
TOYOTA MTR 1,25% 17	570000	541 809 €
TOYOTA MTR 1,375% 18	797000	758 904 €
TOYOTA MTR 1,45% 18	2500000	2 386 177 €
TOYOTA MTR 2,15%0320	1750000	1 664 717 €
TR INFR 2,2 05/08/25	4300000	4 629 945 €
TRANS CAN 4,875%26	2300000	2 462 261 €
TRANSCANADA 5,875%76	990000	997 762 €
TRANSURBA 3,375 0327	2725000	2 458 239 €
TREEHOUSE 4,875% 22	2750000	2 705 014 €
TRINITY A 2,12512 22	4874000	5 046 938 €
TRINITY ACQ 3,5% 21	1735000	1 676 036 €
TWARN CABL 4% 21	6000000	5 902 429 €
TWARN CABL 4,125%21	1500000	1 488 384 €
TYCO ELECTR 1,1% 23	8131000	8 318 958 €
TYSON FOODS 2,65% 19	3300000	3 187 165 €
UA 2014 1 4% 0426	1250000	1 109 336 €
UBIIM 2,75% 13-2017	4744000	4 874 012 €
UBS AG 4,75% 2026	10100000	11 258 613 €
UBS AG LD 1,125% 20	6600000	6 876 622 €
UBS AG LN 0,5 052018	4510000	4 558 184 €
UBS AG LOND 1,25% 21	9210000	9 696 572 €
UBS AG STA 2,35% 20	7600000	7 216 325 €
UBS GR JEY 3% 21	7000000	6 672 858 €
UBS GROUP 1,75% 22	12230000	12 820 727 €
UBS GROUP FUNDIN	8396000	8 219 753 €
UBS JERSEY 7,152% 17	3650000	3 993 716 €
UBS STAMFORD 1,80%18	405000	385 790 €
UDR 4,25%11-2018	3400	3 340 055 €
UDR 4,625% 01/2022	2000000	2 068 495 €
UNCDBK AUT 2,625% 18	3300000	3 461 298 €
UNDER AR 3250 150626	1725000	1 541 429 €
UNI ROD 1,375 090326	3800000	3 920 245 €
UNIBAIL RD 2,50 26	1900000	2 165 070 €
UNIBAILR 0875 210225	3215000	3 202 752 €
UNIBAIL-RODAM 2,5%24	6000000	6 863 937 €
UNICEM 6,25 09/18	1500000	1 671 629 €
UNICREDIT 1,5% 19	3200000	3 295 563 €
UNICREDIT 2,125% 26	14970000	14 854 907 €
UNICREDIT 3,375% 18	1000000	1 064 172 €
UNICREDIT 4,375% 27	2617000	2 623 098 €
UNICREDIT 4,875% 17	2000000	2 097 171 €
UNICREDIT 5,75%17	5000	5 251 129 €
UNICREDIT 5,75%2025	6500000	6 933 841 €
UNICREDIT 6,7%0618	9000	9 927 316 €
UNICREDIT 6,95% 22	2350000	2 723 453 €
UNICREDIT SPA 2% 23	1963000	2 050 803 €
UNICREDITO 3,25% 21	14605000	16 309 813 €

UNILEV NV 1,125% 28	1400000	1 433 746 €
UNILEVER 1% 23	3765000	3 933 265 €
UNION PAC 4% 21	3000000	3 055 979 €
UNIONE BCHE 2,875%19	3600000	3 867 623 €
UNIONE DI BA 4,25%26	3800000	3 863 249 €
UNIT TECH 1,125% 21	1780000	1 845 005 €
UNITED PARC 2,45% 22	1850000	1 752 194 €
UNITED REN 4,625 723	4000000	3 940 044 €
UNITEDHEALTH 3,10%26	1125000	1 059 396 €
UNITEDHEALTH 3,75%25	3025000	3 016 936 €
UNITYMEDHN 4 25	4213000	4 455 065 €
UNITYMEDHN 5,50% 22	1000000	867 785 €
URENCO FIN 2,5% 21	4000000	4 422 557 €
URENCO FIN, 2,25% 22	13748000	14 874 903 €
US AIR 3,95%13-2025	10000000	8 114 463 €
US BANCORP 1,95% 18	3300000	3 150 662 €
US BANCORP 2,20%19	2580000	2 473 077 €
US BANCORP 2,95 22	3200000	3 087 141 €
US BANCORP 3,10% 26	1050000	969 798 €
US BANK CI 1,45% 18	12500000	11 910 563 €
US BANK NA 1,4% 19	4420000	4 153 745 €
US TREA 2125 301123	5400000	5 093 861 €
US TREAS 0,75% 19	2000000	1 872 746 €
US TREAS 2000 151126	10000000	9 137 719 €
US TREASURY 1,5 0826	16731000	14 667 341 €
US TREASURY N/B	4500000	3 984 482 €
UTD HEALTH 2,87 22	5000000	4 834 059 €
UTD HEALTH 2,875% 23	1500000	1 432 100 €
VALEO SA 1625 0326	8600000	8 976 154 €
VALEO SA 3,25% 24	4100000	4 921 778 €
VALERO 4375 151226	1961000	1 875 550 €
VALERO ENE 3,65% 25	3080000	2 906 611 €
VATTENFALL TREASURY	130	7 820 671 €
VENTAS 4,75% 2021	2000	2 044 743 €
VEOLIA ENVR 0,314 23	11700000	11 389 357 €
VEOLIA ENVT 4,45%49	6800000	7 303 557 €
VEREIT OP 4,87 26	3600000	3 467 243 €
VERISK A 4,125 08/22	3500000	3 471 854 €
VERISK ANAL 4% 25	1900000	1 823 626 €
VERIZON 4,5% 0920	5500000	5 634 274 €
VERIZON COM 0,50% 22	11645000	11 637 160 €
VERIZON COM 0,875%25	10000000	9 845 757 €
VERIZON COM 1,75% 21	4000000	3 658 862 €
VERIZON COM 2,375%22	4774000	5 312 277 €
VERIZON COM 2,625%20	13395000	12 919 534 €
VERIZON COM 2,625%31	3038000	3 252 736 €
VERIZON COM4,522% 48	1000000	909 948 €
VERIZON COMM 3% 2021	10700000	10 268 990 €
VERIZON COMM 3,65%18	1600000	1 580 407 €
VERIZON COMM 5,15%23	9700000	10 280 907 €
VERIZON COMM INC	13930000	12 739 128 €
VESTEDA FI 1,75 19	1010000	1 052 280 €
VF 0,625% 16-2023	3750000	3 733 789 €
VIACOM 2,5% 18	1275000	1 223 385 €
VIACOM INC 3,875% 24	1700000	1 575 682 €
VIENNA INSU 5,5% 43	1900000	2 113 491 €
VIER GAS T 2,87 25	1300000	1 545 356 €
VIER GAS TRANS 2%20	5620000	6 064 365 €
VISA INC 2,2% 20	6500000	6 161 447 €
VISA INC 2,80 122022	1000000	952 172 €
VISA INC 3,15% 12/25	1500000	1 426 671 €
VIVENDI 0,75%16-2021	6000000	6 114 263 €
VIVENDI 1,125%16-23	4300000	4 337 744 €
VODAFONE 0,50% 24	11350000	10 964 928 €
VODAFONE 1,60% 2031	7037000	6 618 730 €
VODAFONE 2,50% 2022	2552000	2 327 334 €

VODAFONE 2,95% 2023	2350000	2 183 711 €
VODAFONE GROUP	3500000	3 645 486 €
VOLKS IF 3,30% 2033	800000	883 079 €
VOLKS IF EI03M 2018	1940000	1 935 907 €
VOLKS LEAS 2,625% 24	4672000	5 191 751 €
VOLKS LEAS 3,25 %18	27	2 869 353 €
VOLKSW INTL 2,5% 22	6000000	5 806 280 €
VOLKSW INTL 3,5% 30	3000000	2 728 405 €
VOLKSW LEAS 2,375%22	5700000	6 164 901 €
VOLKSWAGEN 0,75%20	1900000	1 922 679 €
VOLKSWAGEN 1,875%17	3009000	3 065 747 €
VOLKSWAGEN 2% 21	1047000	1 127 366 €
VOLKSWAGEN 2,125% 22	6650000	7 177 240 €
VOLKSWAGEN 3,875% 18	11500000	12 026 509 €
VOLKSWAGEN 4,625% 26	1788000	1 884 524 €
VOLKSWAGEN BK 1,5%19	7150000	7 439 608 €
VOLVO CAR 3,25% 21	1550000	1 669 617 €
VOLVO T AB 2,375% 17	5543000	5 918 353 €
VONOVIA 0875 100622	8000000	8 083 091 €
VONOVIA 1,25 16-24	14100000	14 035 971 €
VONOVIA FIN 2,25% 23	2000000	2 150 945 €
VRGN EL&PWR 2,95% 26	385000	355 082 €
VW 0,875% 15-2023	2403000	2 420 353 €
VW 3,25% 2019	7500000	8 206 683 €
VW FIN SER 0,75% 21	960000	965 025 €
WACHOVIA BK 6% 11/17	3100	3 073 264 €
WALBOOTS3,3%11/2021	1600000	1 550 317 €
WALG BOOT 3,8%11/24	3540000	3 418 675 €
WAL-MART 3,25% 20	4500000	4 466 336 €
WAL-MART 3,30% 2024	1500000	1 469 313 €
WATSON PHA 3,25%2022	3871000	3 680 766 €
WELLCAR HP 5,75 20	3500	3 427 847 €
WELLPOINT 7%19	3755	3 998 447 €
WELLS FA 2500 0321	2000000	1 897 403 €
WELLS FAR 1,625% 25	7539000	7 870 848 €
WELLS FAR 1375 1026	5300000	5 301 690 €
WELLS FAR 3,5% 03/22	11100000	10 926 304 €
WELLS FAR 5,875% 25	2305000	2 284 881 €
WELLS FARG 3000 0426	1500000	1 362 427 €
WELLS FARGO 1% 2027	12494000	12 016 761 €
WELLS FARGO 1,125%21	3873000	4 009 151 €
WELLS FARGO 1,5% 18	3300000	3 143 601 €
WELLS FARGO 1,5%22	3600000	3 778 549 €
WELLS FARGO 2% 26	1100000	1 179 817 €
WELLS FARGO 2,15%20	4700000	4 469 030 €
WELLS FARGO 2,25% 23	5685000	6 282 406 €
WELLS FARGO 2,25%20	5000000	5 401 492 €
WELLS FARGO 3% 2026	7120000	6 452 744 €
WELLS FARGO 4,10% 26	3025000	2 907 110 €
WELLS FARGO 4,6%2021	8000	8 230 964 €
WELLS FARGO 7,98% 18	3289000	3 329 330 €
WENDEL SA 1% 0423	2700000	2 650 333 €
WESFARMERS 1,25% 21	6560000	6 886 615 €
WESFARMERS 2,75% 22	6250000	7 058 587 €
WESTERN GA 5,375% 21	1610000	1 639 119 €
WESTERN GAS 4%2022	800000	770 066 €
WESTPAC BANK 2,85%26	3375000	3 063 360 €
WFI WSTUKF 3,75 24	2800000	2 705 547 €
WHOLE FOODS 5,2%25	2200000	2 219 653 €
WILL PART 4,30% 24	2350000	2 275 858 €
WILL PART 5,25% 2020	1141	1 174 883 €
WILLIAMS PAR 3,9%25	6975000	6 581 772 €
WILLOW N0,2 3,375%22	6730000	7 875 754 €
WOLTERS KW 2,87% 23	3900000	4 534 895 €
WOODSIDE FIN,3,70%26	2800000	2 573 918 €
WPP FINAN 2,25% 26	2600000	2 857 046 €

WPP FINANC 3,625%22	3100000	3 032 025 €
WPP FINANCE 1,625%30	8200000	8 089 019 €
XEROX 2,75% 19	2840000	2 715 503 €
YORKSH BLD 2,125%19	11473000	12 126 970 €
YORKSHRE BLD 1,25%22	3900000	3 945 793 €
ZF NA CAP 2,75% 23	2800000	3 003 787 €
ZF NA CAPIT 4,5 0422	1900000	1 874 781 €
ZF NORTH A 2,25% 19	1500000	1 580 991 €
ZIMMER BIO 2,425%26	2576000	2 639 899 €
ZIMMER BIOM 1,414%22	2081000	2 110 576 €
ZIMMER HLDGS 2,70%20	1850000	1 765 301 €
ZOETIS 3,25%13-2023	6000000	5 719 513 €
ZUERCH KBK 2,625%27	13400000	13 587 163 €
ZURICH 7,50%09-2039	100	5 961 766 €

TCN	
Encours sous gestion dans la poche	1 523 342 214 €

Libellé des valeurs	Quantité de titres	Valeur des titres au 31/12/2016
CR07 -0,2% 01/08/16	4500000	4 501 349 €
CR07 -0,2% 11/02/16	1000000	1 000 377 €
CR07 -0,2% 14/10/16	1500000	1 502 722 €
CR07 -0,2% 16/11/16	500000	501 062 €
CR07 -0,2% 26/10/16	2000000	2 003 979 €
CR07 -0,2% 03/10/16	2000000	2 003 423 €
CR07 07/04/16	850000000	850 737 128 €
CR07 14/11/16	150000000	150 128 098 €
CR07 15/04/16	210000000	210 201 707 €
CR16 0,02% 07/04/16	250000000	250 222 605 €
CR16 -0,1% 11/08/16	3000000	3 001 012 €
CR16 -0,1% 23/05/16	3500000	3 501 869 €
CR16 -0,2% 03/10/16	2000000	2 001 795 €
CR16 -0,2% 04/11/16	3000000	3 002 784 €
CR16 -0,2% 07/10/16	4000000	4 006 996 €
CR16 -0,2% 09/11/16	2000000	2 000 503 €
CR16 -0,2% 14/10/16	1500000	1 502 810 €
CR16 -0,2% 17/10/16	500000	500 147 €
CR16 -0,2% 21/10/16	3000000	3 003 093 €
CR16 -0,2% 21/11/16	7500000	7 503 561 €
CR16 -0,2% 23/05/16	1500000	1 501 997 €
CR16 -0,2% 24/08/16	2500000	2 500 377 €
CR16 -0,2% 26/10/16	2000000	2 003 979 €
CR16 -0,2% 28/10/16	2000000	2 001 725 €
CR16 -0,2% 29/07/16	3000000	3 000 843 €
CR16 -0,3% 02/11/16	2000000	2 000 600 €
CR16 -0,3% 05/12/16	2000000	2 003 000 €
CR16 -0,3% 09/12/16	1000000	1 000 698 €
CR16 -0,3% 21/11/16	1500000	1 500 563 €
CR24 -0,1% 20/12/16	3000000	3 001 410 €

OPC	
Encours sous gestion dans la poche	6 792 392 160 €

Libellé des valeurs	Quantité de titres	Valeur des titres au 31/12/2016
ABERDEN GL EMERG MKT	18609336,77	150 332 036 €
ACADIAN GLBL EQTY	810000	14 191 200 €
ALLIANZ EURO HIGH	25274,922	54 065 838 €
ALLIANZ GBL ECO	139500	13 813 290 €
AMUNDI CASH INSTITUT	104476,988	1 044 882 935 €
AVIVA I EMERG, MARKT	75257,9225	99 630 658 €
AXA WORLD FUNDS	1371259,096	281 779 281 €
BAER LOC,EM,C 3DEC	1651177,54	463 832 561 €
BNP PARIBAS AQUA I	265	9 313 475 €

BNP PARIBAS INVEST3M	220,507	222 061 654 €
BNPP MOIS	4691,368	108 657 426 €
BNY MELLON GL-EMM	118080878,8	162 732 748 €
BRSF SIC	824064,48	90 465 443 €
CARMIGNAC EMR PATRIM	521259,739	60 309 752 €
CIP EM,TOT,OPP A7C	7299270,07	81 532 847 €
COMGEST EMERG 3DEC	7498824	230 705 702 €
DIMENSIONAL EMERG	12292702,08	236 880 369 €
FIDELITY FDS EMERG	20234951,18	209 112 081 €
FIDELITY FUNDS HIGH	11234615,88	127 391 331 €
FIRST STATE WORLDW	5300000	8 905 060 €
FISHER EMERG MRKTS	1751021,228	198 093 032 €
FRANK TEMP INV EMKT	18803140,54	446 569 017 €
GOLDMAN SACHS N-11SM	6421802,669	50 534 214 €
HENDERSON GLOBAL	7900000	14 125 200 €
HSBC EU,C,H,I	2254254,229	99 308 916 €
HSBC GIF GL	2439467,517	88 345 845 €
JANUS CAP FUND HIGH	723377,429	87 436 254 €
JUPITER ECOLOGY CL,I	2980000	13 265 119 €
NEUBER BERGMAN	16762862,31	347 256 261 €
PARVEST ENVIRT OPPO	104000	18 851 040 €
PICTET CLEAN ENERG	245000	18 700 850 €
PICTET FUND LUX	1279147,607	215 275 176 €
PICTET FUNDS LUX -EM	243515,2813	95 159 700 €
PICTET WATER CL,I	29900	9 251 060 €
PIMCO EMERGING	10756526	117 992 895 €
PIONEER FUNDS EUR HG	42120,498	80 874 305 €
QUONIAM-EM MKT EQUIT	219608,405	235 756 211 €
SCHRODER INTL FUND	904860,08	132 051 407 €
SCHRODER SICAV	830000	12 928 246 €
SCHRODERS INTL EMERG	22818132,62	349 295 411 €
SPARINVEST ETHICAL	61000	10 233 360 €
STONE HARBOR-EM MKLC	2182601,189	242 895 215 €
SWISSCANTO LU EQTY	52000	9 160 840 €
THRE,EUR,H,Y, EUR	21851445,81	60 609 355 €
TOBAM A/B EM MK EQ-A	18870,942	153 768 173 €
VONTOBEL NEW POWER I	137500	14 059 375 €

CAPITAL INVESTISSEMENT

Encours sous gestion dans la poche	468 501 903 €
---	----------------------

Libellé des valeurs	Valeur des titres au 31/12/2016
AXA SEC, FUND IV LP	42 647 513 €
LP ACCESS CAPITAL PA	103 336 342 €
NEUBERGER BERMAN EUR	107 128 286 €
PANTHEON FRR EUROPE	149 864 797 €
ANTIN INFRASTRUCT, B	42 165 320 €
MERIDIAM TRANSIT A	205 351 €
FPS IMMO DURABLE	23 154 294 €

FONDS DE PRETS A L'ECONOMIE

Encours sous gestion dans la poche	697 132 461 €
---	----------------------

Libellé des valeurs	Valeur des titres au 31/12/2016
BNPP FPS FPE I PLU	95 873 826 €
CMCIC PR VRN FCT	78 993 360 €
FCT CEREAL DETTE	31 714 981 €
FCT IDINVEST 2	79 709 840 €
FCT NOVO 1	86 810 563 €
FCT NOVO 2	39 653 878 €
FCT SP EUROCREANCES	13 812 822 €
IDINVEST FCT 24	50 764 318 €

IDS 3 FCT	101 468 618 €
NOVI 1	32 168 634 €
NOVI 2	45 184 700 €
TIKEHAU CLL EURIB 28	40 976 920 €