



**FRR PORTFOLIO COMPOSITION
AS OF DECEMBER 31, 2013**

EQUITIES	
TOTAL (€)	8 280 440 960 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
21ST CENTURY SHS A	29 505	753 096 €
3M	33 394	3 399 019 €
AAC TECHNO HOLD NV	160 033	563 934 €
AALBERTS INDUST.	128 457	2 976 991 €
AAREAL BANK	170 500	4 907 843 €
ABACUS PROPERTY	64 620	97 337 €
ABB LTD NOM.	71 854	1 376 689 €
ABBOTT LABO.	174 114	4 843 450 €
ABBVIE	128 854	4 938 515 €
ABCAM	295 200	1 742 106 €
ABERCROMBIE CL.A	5 181	123 744 €
ABERDEEN ASSET	110 000	661 058 €
ABERTIS INFRAES.A	444 942	7 185 813 €
ACADIA REALTY TRUST	24 461	440 792 €
ACCENTURE PLC-CL	35 705	2 130 536 €
ACCIONA	23 618	986 406 €
ACCOR	227 618	7 807 297 €
ACCORDIA GOLF	86 100	788 294 €
ACE NOM.	130 100	9 775 204 €
ACERGY	77 906	1 081 937 €
ACERINOX	164 206	1 518 413 €
ACRUX LIMITED	35 987	59 815 €
ACS ACT.CONSTR.	135 876	3 399 618 €
ACTAVIS PLC	90 922	11 085 635 €
ACTIVISION	114 831	1 485 911 €
ADELAIDE BRIGHTON	109 076	259 907 €
ADIDAS NOM.	203 933	18 892 353 €
ADMIRAL GROUP	192 054	3 023 927 €
ADOBE SYSTEMS	25 219	1 095 935 €
ADP (PROMESSE)	98 662	8 139 615 €
ADT CORP	7 286	213 996 €
ADVANCE RESIDENCE	534	836 967 €
AED OIL LTD	34 369	- €
AEDIFICA	2 197	113 211 €
AEGON	1 324 350	9 087 690 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
AEON CREDIT SCE.	167 600	3 263 357 €
AEON MALL	316 765	6 454 281 €
AES	730 909	7 696 850 €
AETNA	15 248	759 025 €
AF AB-B	200 000	5 084 746 €
AFFILIATED MANAGER	2 459	387 044 €
AFFINE	1 569	21 872 €
AFLAC	13 249	642 306 €
AGCO	127 457	5 475 129 €
AGEAS	151 834	4 699 262 €
AGGREKO	32 500	667 578 €
AGILE PROPERTY	557 186	433 366 €
AGILENT TECHN.	99 364	4 124 122 €
AGL ENERGY	126 218	1 231 695 €
AGNICO EAGLE MINES	61 426	1 176 033 €
AGREE REALTY	3 589	75 588 €
AGRIUM	8 008	531 496 €
AIA GROUP LTD	3 441 505	12 530 025 €
AIDA ENGINEERING	34 700	272 894 €
AIMS AMP	116 582	95 823 €
AINSWORTH GAME TEC	30 559	87 102 €
AIR FRANCE	232 198	1 761 454 €
AIR LIQUIDE	342 602	35 219 486 €
AIR LIQUIDE PRIME	109 101	11 215 583 €
AIR N.ZEALAND	115 489	113 130 €
AIR PRODUCTS	6 149	498 828 €
AIRGAS	8 178	663 843 €
AISIN SEIKI	68 600	2 022 523 €
AJ LUCAS GROUP	30 950	22 104 €
AKAMAI TECHN.	20 472	700 972 €
AKZO NOBEL	178 314	10 046 211 €
ALCATEL A	4 221 076	13 752 266 €
ALCATEL-LUCENT DS13	29	- €
ALCOA	60 092	463 588 €
ALEXANDER S	919	220 096 €
ALEXANDRIA REAL	30 948	1 428 922 €
ALEXION PHARMA. INC	11 092	1 069 707 €
ALFA LAVAL	40 000	745 763 €
ALGETA	34 430	1 477 707 €
ALIM.COUCHE SUB.	11 087	604 918 €
ALLEGHANY	7 122	2 067 287 €
ALLEGHENY TECHN.	8 888	229 828 €
ALLEGION	8 390	269 072 €
ALLERGAN	142 752	11 508 014 €
ALLIANCE DATA SYS.	2 614	498 802 €
ALLIANT ENERGY	5 551	207 875 €
ALLIANZ	242 492	31 608 832 €
ALLIED PROPERTIES	29 976	670 752 €
ALLREAL HOLDING	4 743	477 977 €
ALLSTATE	151 171	5 983 646 €
ALPS ELECTRIC	255 000	2 104 019 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
ALS LTD	85 830	490 951 €
ALSTOM REGROUPT	305 285	8 082 420 €
ALSTRIA OFF.REIT	30 506	279 191 €
ALTERA	10 128	238 966 €
ALTRIA GROUP	163 187	4 546 592 €
ALUMINA	557 809	403 816 €
AMADA	263 000	1 683 360 €
AMADEUS IT HOLDING	306 847	9 544 476 €
AMAZON COM	9 200	2 662 652 €
AMB GENERALI PORT.	6 163	692 721 €
AMCOM TELECOM	50 564	71 568 €
AMCOR	276 833	1 896 240 €
AMDOCS	33 972	1 016 768 €
AMER GROUP S.A	165 500	2 502 360 €
AMER RLTY CAP	69 951	652 399 €
AMER.ELECT.POWER	37 368	1 267 567 €
AMEREN	22 257	584 087 €
AMERI TOWER NV	66 910	3 876 011 €
AMERICAN ASSETS TR	15 062	343 565 €
AMERICAN CAMPUS	45 992	1 075 116 €
AMERICAN CAPITAL	52 886	740 381 €
AMERICAN EAGLE	28 579	298 670 €
AMERICAN EXPRESS	74 247	4 888 911 €
AMERICAN HOMES 4 A	23 533	276 678 €
AMERICAN INTL GRP	38 653	1 432 060 €
AMERICAN WATER WKS	11 716	359 328 €
AMERIPRISE FCIAL	98 200	8 199 369 €
AMERISOURCEBERGEN	65 811	3 358 133 €
AMETEK INC	172 544	6 595 466 €
AMGEN	245 167	20 298 027 €
AMLIN	529 121	2 918 433 €
AMP	672 286	1 916 203 €
AMP NZ OFFICE	147 842	87 423 €
AMPHENOL CL.A	6 218	402 439 €
AMVIG	82 990	28 662 €
ANADARKO PETROLE.	188 588	10 856 231 €
ANALOG DEVICES	10 579	391 021 €
ANDRITZ AG	142 434	6 493 566 €
ANF	1 675	37 386 €
ANGLO IRISH BANK	1 655 585	- €
ANNALY CAP.MGMT	105 529	763 571 €
ANRITSU	321 700	2 569 957 €
ANSELL	34 103	457 674 €
ANSYS	15 728	995 342 €
ANTON OILFLD SVCES	201 524	89 027 €
AOKI HOLDINGS	131 000	1 649 824 €
AON PLC	37 068	2 256 793 €
APA GROUP ST.SECU.	185 460	722 478 €
APACHE	43 452	2 710 113 €
APARTMENT INVEST.A	63 969	1 202 872 €
API	82	469 364 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
APN NEWS AND MEDIA	99 613	29 104 €
APPLE	90 273	36 755 177 €
APPLIED MATERIALS	43 485	557 961 €
APR ENERGY PLC	151 513	1 730 016 €
AQUILLA RESOURCES	38 866	58 039 €
ARA ASSET MNGMT	95 013	101 577 €
ARB CORP	14 086	107 095 €
ARC RESOURCES	19 836	400 636 €
ARCELORMITTAL	800 632	10 384 197 €
ARCH CAPITAL GROUP	56 791	2 460 160 €
ARCHER DANIELS	24 596	774 705 €
ARCS CO	32 200	447 994 €
ARDENT LEISURE GROUP	89 096	116 273 €
ARISTOCRAT LEISURE	107 139	326 245 €
ARKEMA	113 906	9 658 090 €
ARRIUM	307 677	349 588 €
ARROW ELECTRON.ORD	6 538	257 411 €
ARTIS REAL	61 922	628 504 €
ASAHI KASEI	729 000	4 147 594 €
ASCENDAS HOSPIT TR	182 595	75 565 €
ASCENDAS INDIA TR	153 652	60 055 €
ASCENDAS REAL EST	1 315 769	1 663 807 €
ASCIANO UNIT	224 458	839 422 €
ASCOTT RESID.REIT	166 094	115 038 €
ASHFORD HOSPITALI.	28 208	169 506 €
ASHLAND	3 671	258 534 €
ASHTHAD GROUP	1 709 198	15 612 866 €
ASIAN PAY TELEV.	319 206	135 770 €
ASIASONS CAPITAL	99 399	6 856 €
ASM PACIFIC TECHN.	54 865	333 268 €
ASML HOLDING	305 110	20 759 684 €
ASPEN GR	23 459	24 065 €
ASSA ABLOY S.B	73 858	2 835 813 €
ASSICURAZ.GEN.ORD.	795 340	13 600 314 €
ASSOCIATED BRITISH	151 850	4 462 419 €
ASSOCIATED ESTATES	22 581	263 027 €
ASSURANT	14 906	717 985 €
ASSYSTEM	70 800	1 424 496 €
ASTELLAS PHARMACEUTI	161 800	6 959 981 €
ASTRAZENECA	229 750	9 870 690 €
ASTRO JAPAN UNIT	14 414	32 287 €
ASX	44 033	1 050 937 €
AT AND T	294 625	7 517 973 €
ATLANTIA	493 665	8 051 676 €
ATLAS COPCO CAT.A	55 543	1 119 019 €
ATLAS IRON	202 692	151 341 €
ATOS ORIGIN	122 655	8 069 472 €
AUCKLAND INTL ARPT	227 419	479 506 €
AURIZON HLDGS LTD	469 934	1 488 948 €
AURORA OIL & GAS	102 603	201 182 €
AUS.NZL BKG GROUP	622 057	13 017 074 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
AUSDRILL LTD	64 396	43 064 €
AUSENCO	14 477	5 922 €
AUSTRALAND PROP.	244 696	611 661 €
AUSTRALIAN AGRIC	100 203	81 323 €
AUSTRALIAN PHARM.	83 049	32 353 €
AUSTRALIAN WLD.	118 702	102 887 €
AUTODESK INC	12 830	468 534 €
AUTOLIV	6 343	422 590 €
AUTOLIV SWED.DEPOS	18 489	1 236 778 €
AUTOM.DATA PROCES.	89 202	5 230 737 €
AUTOMOTIVE HOLDINGS	59 269	145 460 €
AUTONATION	4 581	165 201 €
AUTOZONE	11 926	4 136 666 €
AVAGO TECHNOLOGIES	50 217	1 927 153 €
AVALONBAY COMMUN.	66 731	5 725 819 €
AVEO GROUP	85 853	114 827 €
AVERY DENNISON	5 785	210 719 €
AVEVA GROUP PLC	242 625	6 310 583 €
AVIVA	10 695	57 807 €
AVNET	114 231	3 656 818 €
AVON PRODUCTS	31 297	391 127 €
AXA	2 248 937	45 451 017 €
AXEL SPRINGER	188 339	8 795 431 €
AXIS CAPITAL	12 014	414 766 €
AXIS COM	347 700	8 792 685 €
AZ ELECT.MATERIALS	345 852	1 641 966 €
AZIMUT HOLDING	325 000	6 444 750 €
BABCOCK & WILCOX	12 848	318 799 €
BABCOCK INTL GRP	250 147	4 073 908 €
BAKER HUGHES ORD.	23 576	945 504 €
BALL	11 081	415 447 €
BALOISE HOLDING	8 600	797 193 €
BANCA GENERALI	144 640	3 255 846 €
BANCO BILBAO VIZC.	3 323 205	29 736 038 €
BANCO POP.ESPANOL	934 130	4 096 160 €
BANCO POPOLARE	1 442 035	2 010 197 €
BANCO SABADELL	2 854 498	5 412 128 €
BANK AMERICA	1 301 445	14 706 073 €
BANK IRELAND	19 231 649	4 846 376 €
BANK N.Y. MELLON	30 525	774 035 €
BANK NOVA SCOTIA	128 685	5 838 970 €
BANK OF EAST ASIA	305 718	939 962 €
BANK OF MONTREAL	21 948	1 061 533 €
BANK QUEENSLAND	70 870	559 524 €
BANKINTER	1 337 800	6 671 609 €
BARCLAYS	1 310 886	4 284 801 €
BARD (C.R.)	30 453	2 960 211 €
BARRATT DEV.	724 000	3 036 971 €
BARRICK GOLD	186 432	2 382 530 €
BARRY CALLEBAUT N.	9 068	8 272 561 €
BASF SE	512 607	39 721 916 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
BATHURST RESOURCES	157 476	19 753 €
BAXTER INTL	172 044	8 683 983 €
BAYER	575 351	58 657 034 €
BB AND T	190 692	5 164 834 €
BCA MONTE PASCHI	7 777 646	1 364 199 €
BCE	131 370	4 127 605 €
BCO ESPIRITO SANTO	2 733 084	2 839 674 €
BCO SANT.CENT.HISP	5 981 021	38 912 523 €
BE AEROSPACE	103 358	6 528 229 €
BEACH PETROLEUM	289 428	268 720 €
BEADELL RESOURCES	166 360	85 329 €
BEAM	6 467	319 431 €
BECHTLE	56 000	2 770 040 €
BECTON DICKINSON	54 600	4 378 223 €
BED BATH BEYOND	121 503	7 080 841 €
BEFIMMO SCA SICAFI	7 894	398 252 €
BEIERSDORF NOM.	290 482	21 391 094 €
BELGACOM	445 099	9 571 854 €
BELIMO HOLDING	3 925	7 878 825 €
BELL ALIANT	37 871	691 433 €
BEMIS CO	10 953	325 593 €
BEND.AND ADEL.BANK	92 532	705 915 €
BENETEAU	255 247	3 463 702 €
BENI STABILI	163 403	80 067 €
BERKLEY	72 842	2 293 791 €
BERKSHIRE HATHAW.A	13	1 678 424 €
BERKSHIRE HATHAWAY B	327 944	28 217 607 €
BERTRANDT	18 900	2 097 900 €
BEST BUY	269 693	7 805 615 €
BETTSSON B	125 000	2 881 356 €
BG GROUP	984 929	15 359 920 €
BGP HOLDINGS	3 056 274	- €
BHP BILLITON	735 017	18 129 656 €
BHP BILLITON	257 509	5 784 667 €
BIC	115 610	10 296 227 €
BIG YELLOW	57 683	331 400 €
BILFINGER BERGER	54 775	4 465 806 €
BILLABONG INTL	83 118	27 253 €
BIOGAIA B	66 000	1 890 508 €
BIOGEN IDEC	13 232	2 684 735 €
BIOMED REALTY TR.	84 524	1 111 528 €
BIOMERIEUX	39 543	3 015 945 €
BIOSENSORS INTL GR	243 236	116 739 €
BLACKBERRY	28 692	154 822 €
BLACKROCK	43 196	9 921 067 €
BLOCK (H.AND R.)	47 224	995 272 €
BLUESCOPE STEEL	128 375	485 094 €
BLUMONT GROUP	363 012	17 944 €
BMW	187 890	16 011 986 €
BNP PARIBAS	1 159 841	65 704 993 €
BOARDWALK REAL	17 530	716 622 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
BOART LONGYEAR	94 608	23 649 €
BOC HKG HOLD.	823 414	1 915 131 €
BOEING	45 967	4 553 332 €
BOLLORE INVEST.	12 066	5 147 959 €
BOLLORE NV 14	32	13 376 €
BOLSAS MERCADOS	148 000	4 093 680 €
BOMBARDIER CV CL.B	94 097	296 293 €
BONDUELLE	122 000	2 348 500 €
BOOKER GRP PLC	1 500 000	2 929 688 €
BORAL (NEW)	175 210	542 625 €
BORG WARNER	67 770	2 749 852 €
BOSHIWA INTL	122 000	- €
BOSTON PROPERTIES	69 327	5 049 968 €
BOSTON SCIENTIFIC	75 841	661 593 €
BOUYGUES	255 752	7 012 720 €
BP	1 208 311	7 087 935 €
BRADKEN	39 136	153 220 €
BRAMBLES	356 351	2 117 005 €
BRAMMER	800 000	4 326 923 €
BRANDYWINE RLTY PB	69 287	708 508 €
BRE PROPERTIES INC	33 732	1 339 341 €
BREMBO	100 000	1 958 000 €
BRENNTAG	105 239	14 180 955 €
BREVILLE GROUP	21 634	125 433 €
BRIDGESTONE	476 850	13 104 074 €
BRIGHTOIL PETRO HLD	669 887	133 547 €
BRISTOL MYERS ORD.	199 272	7 686 557 €
BRIT.AMER.TOBACCO	332 923	12 956 787 €
BRITISH LAND	1 160 974	8 777 075 €
BRITISH SKY BROAD.	511 846	5 192 284 €
BRIXMOR PROPERTY	22 363	329 951 €
BROADCOM CL.A	183 741	3 953 118 €
BROADRIDGE FINL	23 002	659 728 €
BROCADE COMM SYST	739 146	4 755 446 €
BROOKFIELD ASSET	15 264	429 755 €
BROOKFIELD PROP.	124 780	1 742 940 €
BROWN AND BROWN	10 837	246 878 €
BROWN FORMAN CL.B	9 928	544 494 €
BRUNEL INTL	40 649	1 808 474 €
BT GROUP	657 554	2 998 509 €
BUNGE	12 119	722 179 €
BUNNINGS WAREHOUSE	387 087	550 396 €
BURBERRY GROUP	352 793	6 428 296 €
BURCKHARDT COMPRES	10 969	3 499 697 €
BUREAU VERITAS	772 441	16 410 509 €
BURU ENERGY LIMITE	52 284	59 406 €
BUZZI UNICEM ORD.	111 875	1 466 681 €
CA	20 612	503 370 €
CA IMMOBILIEN ANL.	30 114	387 868 €
CABCHARGE AUSTRAL.	27 867	72 191 €
CABLEVISION NY A	35 573	462 896 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
CABOT OIL GAS	23 574	663 131 €
CACHE LOGISTIC	157 299	100 810 €
CAFE DE CORAL HOLD	75 242	176 057 €
CALLOWAY REAL ESTATE	44 811	770 086 €
CALPINE	37 941	537 215 €
CALTEX AUSTRALIA	31 029	403 929 €
CAMBRIDGE INDUST	271 535	107 690 €
CAMDEN PROPERTY PB	44 916	1 854 142 €
CAMECO	14 698	221 266 €
CAMERON INTL	7 533	325 451 €
CAMPBELL SOUP	65 786	2 066 346 €
CAMPUS CREST CMNTI	29 021	198 191 €
CAN.NAT.RAILWAY	20 052	829 445 €
CANADIAN APARTMENT	43 014	624 328 €
CANADIAN IMBK COMM	17 903	1 109 361 €
CANADIAN NATU.RES.	28 656	703 457 €
CANADIAN OIL SANDS	27 205	371 269 €
CANADIAN PACIFIC	4 539	498 064 €
CANADIAN REAL EST.	27 307	808 924 €
CANADIAN TIRE CL.A	5 899	400 868 €
CANADIAN UTILITIES	24 499	596 892 €
CANCOM SE	93 000	2 864 400 €
CAP GEMINI	282 971	13 902 365 €
CAP&COUNTRY PROPERTY	288 375	1 141 022 €
CAPE LAMBERT IRON	100 516	8 484 €
CAPITA GROUP	292 000	3 642 981 €
CAPITACOMM.REIT	1 293 969	1 078 431 €
CAPITAL ONE FCIAL	278 912	15 507 256 €
CAPITALAND	1 694 190	2 950 567 €
CAPITAMALL TRST FD	1 733 805	1 898 436 €
CAPITAMALLS ASIA	2 501 687	2 818 316 €
CAPITARETAIL	109 171	83 456 €
CARDINAL HEALTH	37 786	1 832 123 €
CARDNO LTD	30 530	136 773 €
CAREFUSION CORP	14 268	412 332 €
CARGOTEC B	116 544	3 157 177 €
CARL ZEISS MEDITEC	290 000	7 022 350 €
CARMAX	16 328	557 183 €
CARNIVAL PAIRED	8 551	249 288 €
CARREFOUR	805 249	23 199 224 €
CARSALES.COM.AU	47 437	313 844 €
CASH CONVERTERS UN	61 399	38 668 €
CASINO GUICHARD	75 429	6 318 687 €
CASIO COMPUTER	87 400	776 661 €
CASTELLUM	69 855	790 111 €
CATAMARAN	10 287	354 482 €
CATERPILLAR	16 693	1 100 146 €
CATHAY PAC.AIRWAYS	233 744	358 788 €
CATLIN GROUP	80 000	558 173 €
CBL ASSOCIAT.PROP.	72 398	943 659 €
CBRE GP A	16 997	324 422 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
CBS CL.B	354 770	16 411 234 €
CDL HOSPITAL TRUSTS	424 715	400 352 €
CEDAR SHOPPING	11 137	50 597 €
CELANESE SER.A	10 849	435 487 €
CELESIO NOM.	125 732	2 891 836 €
CELGENE	107 658	13 201 798 €
Cenovus Energy	22 127	459 452 €
CENTERPOINT ENERGY	44 340	745 919 €
CENTRAL JAP.RAILW.	13 300	1 136 878 €
CENTRICA	2 177 312	9 099 175 €
CENTURY LEAS. SYS.	23 500	563 039 €
CENTURYTEL	92 312	2 133 781 €
CERNER	15 630	632 278 €
CF INDUSTRIES	8 950	1 513 686 €
CFG LTD	137 917	30 520 €
CFS RETAIL PROP.	1 234 735	1 559 252 €
CH ROBINSON WORLD.	9 947	421 226 €
CHALLENGER DIV	23 579	38 273 €
CHALLENGER FCIAL	125 968	507 078 €
CHAMBERS STREET PR	88 616	491 990 €
CHAMPION REIT	1 669 632	536 005 €
CHAODA MODERN	670 000	- €
CHARTER CIONS CL A	4 573	453 882 €
CHARTER HALL GROUP	67 628	160 266 €
CHARTER HALL REIT	217 033	505 875 €
CHARTWELL RETIREMENT	85 342	582 334 €
CHECK POINT SOFTW.	76 853	3 597 461 €
CHESAPEAKE ENERGY	42 922	845 419 €
CHESAPEAKE LODGING	21 674	397 805 €
CHEUNG KONG	114 188	523 151 €
CHEUNG KONG HOLD.	301 717	3 456 489 €
CHEVRONTEXACO	68 170	6 179 777 €
CHINA AEROSPACE	520 015	42 344 €
CHINA HIGH PRECIS.	152 000	- €
CHINA MENGNIU	315 401	1 086 338 €
CHINA METAL RECYCLIN	89 400	- €
CHINA MILK PRODUCTS	239 000	- €
CHINA OIL RESOURCE	808 000	11 117 €
CHINA RONG HEAVY	634 700	71 880 €
CHINA TRAVEL INTL	570 000	86 959 €
CHIPOTLE MEXICAN A	18 403	7 115 720 €
CHIYODA	35 700	499 401 €
CHIYODA	157 000	1 654 229 €
CHOCOL.LINDT SPRUN	194	7 614 361 €
CHOCOLAD.LINDT BP	1 163	3 815 931 €
CHORUS	83 717	72 006 €
CHOW SANG INTL	47 923	99 127 €
CHOW TAI FOOK JEWL	251 866	272 509 €
CHR. HANSEN HOLD.	401 101	11 580 922 €
CHRISTIAN DIOR	77 121	10 592 569 €
CHUBB	42 137	2 955 003 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
CHUO MITSUI TRUST	591 480	2 262 514 €
CHURCH AND DWIGHT	35 008	1 683 961 €
CI FINANCIAL	13 624	328 956 €
CIE FIN RICHEMONT	63 585	4 607 383 €
CIGNA	170 623	10 832 499 €
CIMAREX ENERGY	5 647	429 949 €
CINCINNATI FCIAL	10 360	393 754 €
CINEWORLD GROUP	238 211	1 087 983 €
CINTAS	9 993	432 167 €
CINTRA CONCESIONES	322 120	4 530 618 €
CISCO SYSTEMS	1 237 068	20 137 481 €
CIT GROUP	7 373	278 942 €
CITIC 21 CN CO	484 639	25 402 €
CITIC TELECOM INTL	298 219	69 501 €
CITIGROUP	954 015	36 079 339 €
CITRIX SYSTEMS	7 115	326 601 €
CITY DEVELOPMENTS	395 312	2 181 282 €
CITY NATIONAL	5 914	340 015 €
CITY TELECOM (H.K.	90 912	29 951 €
CITYCON	91 480	234 189 €
CITYSPRING INFRA	221 889	59 942 €
CLARCOR INC	4 700	219 497 €
CLEAN HARBORS	28 542	1 242 019 €
CLIFFS NATURAL	6 759	128 568 €
CLOETTA	477 029	1 045 691 €
CLOROX	33 839	2 278 036 €
CLOSE BROTHERS GRP	131 254	2 164 429 €
CLP HOLDINGS	353 368	2 027 410 €
CME GROUP	13 435	765 012 €
CMS ENERGY ORD.	12 662	245 999 €
CNA FINANCIAL	4 587	142 780 €
CNA HONGXING SPRT	449 000	- €
CNH INDUSTRIAL NV	742 601	6 152 449 €
CNP ASSURANCES	292 125	4 352 663 €
COACH	11 412	464 878 €
COALSPUR MINES LTD	82 310	12 291 €
COBALT INTL ENERGY	13 886	165 777 €
COCA-COLA	475 237	14 247 798 €
COCA-COLA AMATIL	123 180	962 119 €
COCA-COLA ENTREPRISE	251 827	8 065 263 €
COCHLEAR	13 134	502 438 €
COFINIMMO	6 848	614 608 €
COGNIZANT TECHN.A	193 216	14 159 918 €
COLE REIT	323 252	3 293 750 €
COLGATE PALMOLIVE	74 370	3 519 608 €
COLOPLAST B NV	190 996	9 190 993 €
COLRUYT	199 313	8 088 122 €
COMCAST CL.A	755 557	28 494 462 €
COMCAST CL.A SPL	47 586	1 722 614 €
COMERICA	10 718	369 790 €
COMFORTDELGRO	459 000	530 285 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
COMINAR REAL ESTATE	53 437	673 050 €
COMM.BANCSHARES	5 215	169 973 €
COMMERZBANK NV	991 393	11 609 212 €
COMMONWEALTH REIT	52 143	882 106 €
COMPASS GROUP	717 550	8 348 418 €
COMPUGROUP MEDICAL	266 835	4 936 448 €
COMPUTER SCIENCES	10 302	417 792 €
COMPUTERSHARE	113 241	836 698 €
COMSYS HOLDINGS	19 600	223 567 €
COMW.BK AUSTRALIA	368 560	18 617 042 €
COMW.PROP.UNIT	1 342 161	1 084 918 €
CONAGRA FOODS	23 187	567 096 €
CONCHO RESOURCES	6 062	475 140 €
CONOCOPHILLIPS	41 051	2 104 836 €
CONSOL ENERGY INC.	30 817	850 772 €
CONSOL.EDISON	106 760	4 283 107 €
CONST.AUX.FERROC.	25 210	9 688 203 €
CONSTELLATION CL.A	31 111	1 589 079 €
CONTACT ENERGY	83 683	256 417 €
CONTINENTAL	102 927	16 406 564 €
CONTINENTAL RES.	8 505	694 523 €
CONWERT IMMO.INV.	27 329	254 952 €
CORIO	75 871	2 471 498 €
CORNING	68 753	889 164 €
CORP.FINANC.ALBA	29 880	1 269 900 €
CORPORATE OFF.PB	35 610	612 237 €
COSCO	224 890	97 593 €
COSTCO WHOLESALE	101 995	8 810 106 €
COUNTRY GARDEN	1 955 825	856 702 €
COUSINS PROPERTIES	62 082	464 072 €
COVIDIEN	180 345	8 913 197 €
CREDIT AGRICOLE	1 337 892	12 449 085 €
CREDIT CORP GROUP	9 068	56 815 €
CREDIT SUISSE GRP	99 502	2 214 133 €
CREE	15 076	684 049 €
CRESCENT POINT ENE	11 950	336 694 €
CRITERIA CAIXACORP	1 817 570	6 884 955 €
CRODA INTL	312 860	9 239 147 €
CROESUS RETAIL TR	89 414	45 483 €
CROMBIE REIT	24 028	222 219 €
CROWN	86 984	951 617 €
CROWN CASTLE INTL	34 920	1 860 930 €
CROWN HOLDINGS	102 365	3 311 131 €
CSE GLOBAL	92 788	40 799 €
CSL	117 314	5 252 547 €
CSR	116 506	200 455 €
CST MINING GROUP	3 108 229	19 491 €
CSX	93 187	1 945 707 €
CTS EVENTIM	187 246	6 892 525 €
CUDECO LTD	42 990	50 242 €
CUMMINS	6 488	663 773 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
CVS CAREMARK	513 584	26 676 251 €
CYBERAGENT	123 000	3 634 882 €
D R HORTON	33 781	547 204 €
DAEJAN HOLDINGS	1 782	96 661 €
DAH SING BANKING	75 262	96 082 €
DAH SING FINANCIAL	30 858	128 379 €
DAICEL CHEM.IND.	108 000	638 321 €
DAI-ICHI MUTUAL LIFE	86 600	1 050 585 €
DAIICHI SANKYO	53 500	710 354 €
DAILY MAIL GEN.A	92 012	1 062 230 €
DAIMLERCHRYSLER	556 049	34 975 482 €
DAINIPPON PHARM.	64 000	726 921 €
DAISEKI	14 000	198 937 €
DAITO TRUST CONST.	35 400	2 402 693 €
DAIWA HOUSE IND.	51 000	716 599 €
DAIWAHOUSE RESIDEN	124	359 166 €
DAMPSKIBSS.NORDEN	71 000	2 712 357 €
DANAHER	234 629	13 145 627 €
DANSKE BANK	205 670	3 429 533 €
DARDEN RESTAURANTS	22 181	875 231 €
DART ENERGY	157 514	10 738 €
DASSAULT SYSTEMES	127 429	11 497 919 €
DAVID JONES	121 303	237 849 €
DAVIDE CAMPARI	258 813	1 573 583 €
DAVIS SERVICE GRP	119 318	1 343 045 €
DAVITA	36 793	1 692 120 €
DBS GROUP HOLDINGS	587 601	5 775 363 €
DCM JAPAN HOLDINGS	34 400	173 389 €
DCT INDUSTRIAL	128 703	665 979 €
DE LONGHI	666 465	7 910 940 €
DECMIL GROUP	28 353	45 653 €
DEERE	15 434	1 022 997 €
DELHAIZE GROUP PS	114 653	4 953 010 €
DELPHI AUTOMOTIVE	194 030	8 467 250 €
DELTA AIR LINES	40 149	800 416 €
DELTA LLOYD NV	153 500	2 769 140 €
DELTICOM	90 000	2 880 000 €
DENA	113 800	1 738 076 €
DENBURY RESOURCES	30 078	358 648 €
DENSO	89 200	3 418 214 €
DENTSPLY INTL	7 094	249 595 €
DERWENT LONDON	225 022	6 747 955 €
DEU.LUFTHANSA NOM.	162 324	2 503 036 €
DEUTSCHE ANNINGT IMM	9 933	178 794 €
DEUTSCHE BANK NOM.	550 921	19 103 186 €
DEUTSCHE BORSE	251 687	15 151 557 €
DEUTSCHE EUROSHOP	20 289	645 697 €
DEUTSCHE POST NOM.	772 276	20 465 314 €
DEUTSCHE POSTBANK	16 950	656 813 €
DEUTSCHE TELEKOM	2 452 856	30 489 000 €
DEUTSCHE WOHN.POR.	79 078	1 109 860 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
DEUTSCHE WOHNEN E1	48 106	649 190 €
DEVELOPERS DIVERS RE	131 343	1 465 086 €
DEVELOPMENT SECU.	40 771	130 717 €
DEVON ENERGY	18 017	808 993 €
DEVRO	1 468 200	5 082 231 €
DEXUS PTY.UNIT	3 065 370	2 000 193 €
DIA	431 241	2 803 067 €
DIAGEO	485 313	11 666 178 €
DIALIGHT	120 000	1 234 615 €
DIAMOND OFFSHORE	8 683	358 688 €
DIAMONDROCK	86 337	723 704 €
DIASORIN	63 773	2 174 022 €
DIC ASSET AG	21 309	142 557 €
DICKSON PROV.REGPT	40 844	18 044 €
DIGITAL REALTY TRUST	77 788	2 773 022 €
DIGNITY PLC	857 753	14 845 725 €
DIRECT LINE INSURANC	993 617	2 980 851 €
DIRECT TV NV	30 324	1 519 831 €
DISCO	22 300	1 074 736 €
DISCOVER FINANCIAL	232 591	9 444 420 €
DISCOVERY COM CL A	152 456	10 004 406 €
DISCOVERY COM CL C	19 552	1 189 949 €
DISCOVERY METALS	109 450	3 766 €
DISH NETWORK CORP	20 093	844 609 €
DISNEY WALT-DISNEY	353 516	19 601 294 €
DOLLAR GENERAL	46 116	2 018 809 €
DOLLAR TREE	43 828	1 794 597 €
DOLLARAMA	2 663	160 448 €
DOMINION RESOURCES	86 174	4 045 719 €
DOMINO PRINTING	1 799 308	16 544 118 €
DOMINO'S PIZZA UK	1 010 000	6 227 524 €
DOUGLAS EMMETT	58 324	985 823 €
DOUTOR-NICHIRE	24 700	299 306 €
DOVER	131 071	9 183 246 €
DOW CHEMICAL	31 993	1 030 909 €
DOWNER EDI	98 454	310 665 €
DR PEPPER SNAPPLE	25 472	900 643 €
DRAGERWERK PREF.	92 550	8 784 846 €
DRILLSEARCH ENERGY	95 646	83 835 €
DST SYSTEMS	3 553	233 979 €
DSV	93 600	2 230 752 €
DTE ENERGY	13 234	637 641 €
DU PONT DE NEMOURS	23 638	1 114 566 €
DUERR	77 511	5 023 488 €
DUET	283 832	368 565 €
DUKE ENERGY	117 661	5 892 870 €
DUKE REALTY	187 363	2 045 097 €
DULUX GROUP	84 121	292 747 €
DUN BRADSTREET	8 110	722 478 €
DUNDEE INTL REAL E	52 600	302 512 €
DUNDEE REAL ESTATE	45 829	902 149 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
DUNELM GROUP	1 088 610	11 775 829 €
DUPONT FABRS TCHNL	28 661	513 980 €
E.ON	1 089 856	14 620 418 €
EAST JAPAN RAILWAY	47 800	2 765 753 €
EASTGROUP PROPERTIES	13 396	563 198 €
EASTMAN CHEMICAL	6 317	369 970 €
EATON CORP	79 517	4 392 796 €
EBARA	532 000	2 483 132 €
EBAY	101 360	4 035 936 €
ECHO ENTERTAINMENT	186 790	298 340 €
ECOLAB	37 016	2 801 116 €
EDENRED	403 822	9 824 989 €
EDF	435 373	11 182 556 €
EDISON INTL	11 186	375 870 €
EDP ENERG.PORTUGAL	2 862 701	7 643 412 €
EDP RENOVAVEIS	305 195	1 178 358 €
EDUCATION REALTY	50 323	322 120 €
EDWARDS LIFESCIEN.	14 424	688 382 €
EIFPAGE	94 619	3 959 805 €
EIKEN CHEMICAL	79 400	1 088 234 €
ELDORADO GOLD	79 694	328 237 €
ELECTRONIC ARTS A	53 825	896 107 €
ELEKTA S.B	1 902 218	21 139 338 €
ELEMENTIS	2 003 279	6 474 540 €
ELI LILLY ORD	128 009	4 737 977 €
ELIA SYSTEM OPER.	21 523	725 325 €
ELISA CORP.S.A	261 139	5 029 537 €
ELRINGKLINGER	71 257	2 107 069 €
EMC	810 254	14 789 091 €
EMECO HOLDINGS	126 238	18 441 €
EMERSON ELECTRIC	82 468	4 200 308 €
EMPEROR WATCH & JE	618 728	34 167 €
EMPIRE STATE CL A	30 886	342 954 €
EMS CHEMIE HOL.NOM	10 204	2 639 468 €
ENAGAS	222 336	4 223 272 €
ENBRIDGE	104 744	3 320 357 €
ENCANA	35 354	463 160 €
ENDESA	185 192	4 314 974 €
ENEL ENERG.ELET.	3 936 003	12 492 874 €
ENEL GREEN POWER	1 247 025	2 283 303 €
ENERG.RES.A AUDO,2	36 714	30 035 €
ENERGIZER HOLDINGS	11 236	882 636 €
ENI	1 434 155	25 083 371 €
EN-JAPAN INC	58 000	897 052 €
ENQUEST PLC	3 000 000	4 881 356 €
ENSCO	8 114	336 714 €
ENTERGY	9 697	445 264 €
ENVESTRA UNIT	210 388	155 722 €
EOG RESOURCES	157 706	19 209 939 €
EPR PROPERTIES	20 759	740 629 €
EPURE SOUND GLOBAL	130 466	52 492 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
EQUATORIAL RESOURC	21 150	9 063 €
EQUIFAX	5 977	299 696 €
EQUINIX	2 599	334 707 €
EQUITABLE CORP	9 639	628 050 €
EQUITY LIFESTYLE	33 112	870 635 €
EQUITY ONE	26 288	428 117 €
EQUITY RESIDENTIAL	375 311	14 128 298 €
ERAMET	16 362	1 150 085 €
ERIE INDEMNITY C.A	6 278	333 150 €
ERSTE BANK OSTERR.	256 106	6 487 165 €
ESPRIT HOLDINGS	426 372	596 202 €
ESSEX PROPERTY TRUST	16 679	1 737 139 €
ESSILOR INTL	398 690	30 810 763 €
EULER HERMES	52 483	5 253 548 €
EUR.AERO.DEFENCE	774 340	43 215 915 €
EURAZEO	61 831	3 523 130 €
EUROBK PROPERTIES	6 528	52 746 €
EUROCOMM. PROPRTS	18 110	558 875 €
EUROFINS SCIENT.	31 835	6 255 578 €
EUROMONEY INST INV	73 678	1 195 496 €
EUTELSAT COMM.PROM	275 983	6 255 155 €
EVA PRECISION IND	196 696	20 067 €
EVEREST REINS.GRP	22 908	2 591 385 €
EVOLUTION MINING	103 983	41 520 €
EVONIK INDUSTRIES	48 839	1 447 100 €
EVS BROADCAST EQ.	37 600	1 766 824 €
EWC LTD	307 903	75 966 €
EXCEL TRUST	20 573	170 061 €
EXELON	39 652	788 205 €
EXOR ORD.	71 197	2 058 305 €
EXPEDIA	16 127	815 304 €
EXPEDITORS INTL	13 039	418 736 €
EXPERIAN	174 277	2 333 468 €
EXPRESS SCRIPTS	209 038	10 655 947 €
EXTENDICARE	39 232	182 755 €
EXTRA SPACE STORAGE	45 846	1 401 765 €
EXXON MOBIL	599 124	44 002 721 €
EZION HOLDINGS	211 708	270 141 €
EZRA HOLDINGS	140 660	111 167 €
F&C COMMERCIAL	221 960	321 469 €
F5 NETWORKS	6 462	426 110 €
FACEBOOK CL A	334 467	13 265 322 €
FAIRFAX FCIAL VTG	2 969	860 068 €
FAIRFAX MEDIA	422 879	175 719 €
FAMILY DOLLAR STO.	39 242	1 850 318 €
FAR EAST CONSORT.	78 935	21 499 €
FAR EAST HOSPITAL	199 655	96 396 €
FAR EAST ORCHARD	38 003	40 738 €
FASTENAL	14 290	492 719 €
FASTIGHETS AB BALD	38 266	285 374 €
FDAL REALTY INV.	52 125	3 836 270 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
FEDERATION CENTRE	887 009	1 347 618 €
FEDEX	11 084	1 156 504 €
FELCOR LODGING TRUST	55 980	331 517 €
FENNER PLC	1 469 582	8 566 674 €
FIAT ORD.	564 967	3 358 729 €
FIDELITY NATIONAL	58 855	2 292 863 €
FIELMANN	13 824	1 175 455 €
FIFTH THIRD BCP	407 156	6 214 160 €
FIH MOBILE LTD	511 179	199 509 €
FINMECCANICA	374 362	2 060 863 €
FINNING INTL	10 764	199 612 €
FIRST CAPITAL	80 802	977 428 €
FIRST IND.REALTY	47 598	602 791 €
FIRST PACIFIC	536 516	442 900 €
FIRST POTOMAC REALIT	25 959	219 104 €
FIRST REIT	106 775	65 054 €
FIRST REPUBLIC BK	7 745	294 253 €
FIRST RESOURCES LTD	110 516	134 667 €
FIRST SOLAR	5 745	227 815 €
FIRSTENERGY	161 729	3 870 979 €
FISERV	73 204	3 137 162 €
FISHER PAYKEL HEA.	123 270	283 472 €
FISHER PLC	375 000	5 634 014 €
FLEETWOOD CORP	12 265	25 323 €
FLETCHER BUILDING	157 603	801 100 €
FLEXIGROUP LIMITED	46 043	133 627 €
FLEXTRONICS INTL	56 456	318 356 €
FLIGHT CENTRE	12 911	398 596 €
FLINDERS MINES	355 747	7 391 €
FLOWSERVE	161 354	9 231 102 €
FLUOR	104 998	6 118 216 €
FMC	5 784	316 758 €
FMC TECHNOLOGIES	7 895	299 149 €
FONC.DES REGIONS	73 908	4 637 727 €
FOOT LOCKER	22 261	669 494 €
FORD MOTOR	105 229	1 178 375 €
FOREST CITY ENT.A	58 729	814 082 €
FOREST LAB.CL.A	67 894	2 957 890 €
FORGE GROUP LTD	14 525	16 409 €
FORTESCUE METALS	368 495	1 392 443 €
FORTIS	12 754	265 264 €
FORTUM	727 946	12 105 742 €
FORTUNE BRANDS	10 606	351 763 €
FORTUNE REAL EST.	823 553	480 983 €
FOSSIL GROUP	2 396	208 561 €
FOSTER WHEELER AG	7 135	170 885 €
FP	32 900	1 703 722 €
FRANCO NEVADA	69 588	2 057 624 €
FRANKLIN RESOURCES	12 711	532 554 €
FRANKLIN STREET	39 239	340 305 €
FRAPORT AG	52 874	2 875 817 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
FRASERS CENTREPOINT	110 552	111 836 €
FRASERS COMM TRUST	150 799	110 079 €
FREEPORT MCMORAN	45 141	1 236 390 €
FREIGHTWAYS	35 041	98 790 €
FRESENIUS	225 952	25 216 243 €
FRESENIUS MED.CARE	467 586	24 188 224 €
FRIGOGLASS NOM.	391 542	2 000 780 €
FRONTIER COMM. B	189 538	639 634 €
FRONTIER REIT	186	667 817 €
FST QUANTUM MINE.	17 369	227 071 €
FUCHS PETR.ORD.DEM	16 978	1 049 240 €
FUCHS PETROLUB PF	166 459	11 825 247 €
FUGRO	52 291	2 264 985 €
FUJI ELECTRIC HOLD	597 000	2 028 060 €
FUJI HEAVY IND.	224 000	4 663 122 €
FUJIFILM HOLDINGS	31 500	648 357 €
FUJITEC	66 000	622 951 €
FUJITSU	2 229 000	8 372 409 €
FUJITSU GENERAL	183 000	1 417 704 €
FUSHAN ENERGY	810 274	206 279 €
G RESSOURCES GROUP	5 050 359	88 393 €
G.U.D.HOLDINGS	17 219	64 395 €
GAGFAH	49 644	531 191 €
GALAXY	477 990	3 111 500 €
GALAXY RESOURCES L	52 495	1 602 €
GALLAGHER	21 463	731 010 €
GALLANT VENTURE LTD	151 984	23 586 €
GALLIFORD TRY	502 637	7 062 292 €
GALP ENERGIA CL.B	436 920	5 205 902 €
GAM HOLDING	94 200	1 333 635 €
GAMELOFT	988 900	8 099 091 €
GAMESA CORPORACION	294 000	2 228 520 €
GAMESTOP CL.A	23 660	845 846 €
GANNETT	233 792	5 018 918 €
GAP	237 858	6 746 129 €
GARMIN	22 843	765 744 €
GAS NATURAL SDG	321 742	6 014 967 €
GDF SUEZ	1 835 707	31 381 411 €
GEA GROUP	117 392	4 061 763 €
GEBERIT NOM.	3 500	772 542 €
GECINA NOM.	43 764	4 202 657 €
GEMALTO	73 726	5 898 817 €
GEMB SWITZERLAND	23 127	1 104 925 €
GEN.PROPERTY TRUST	1 050 250	2 318 433 €
GENERAL ELECTRIC	570 376	11 602 902 €
GENERAL GROWTH PRO	260 110	3 788 670 €
GENERAL MILLS	157 627	5 709 532 €
GENERAL MOTORS	41 749	1 238 320 €
GENTEX	13 999	335 066 €
GENTING SINGAPORE	1 392 583	1 196 638 €
GENUINE PARTS	14 305	863 657 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
GENUS PLC	364 000	5 674 375 €
GENWORTH FCIAL C.A	31 233	352 020 €
GEOPHYSIQUE(GLE)	294 731	3 707 716 €
GEORG FISCHER NOM.	5 400	2 764 994 €
GEORGE WESTON	7 506	397 333 €
GERRESHEIMER	84 229	4 281 360 €
GERRY WEBER INTL	119 000	3 672 935 €
GESTEVISION TELEC.	374 866	3 144 751 €
GETTY REALTY CORP	11 395	151 917 €
GILEAD SCIENCES	342 294	18 656 128 €
GINDALBIE METALS	217 781	14 140 €
GIORDANO INTL	258 449	167 634 €
GIVAUDAN NOM.	5 446	5 661 529 €
GJENSIDIGE FORSIKR	363 274	5 027 668 €
GK SPARK PLUG	45 000	773 666 €
GLANBIA	340 972	3 839 345 €
GLAXOSMITHKLINE	691 429	13 392 282 €
GLENORE INTL.	2 349 235	8 829 396 €
GLIMCHER REALITY	62 950	427 616 €
GLOBAL LOGISTIC PR	1 919 671	3 188 786 €
GLP J REIT	692	491 180 €
GMG GLOBAL	638 504	37 067 €
GOLDCORP	221 688	3 488 741 €
GOLDEN AGRI-RESOURCE	1 469 610	460 362 €
GOLDMAN SACHS	78 154	10 054 124 €
GOODMAN FIELDER	402 119	178 841 €
GOODMAN GRP UNIT	1 144 512	3 514 830 €
GOODMAN PROPETY T.	196 790	115 780 €
GOOGLE CL.A	46 832	38 090 638 €
GOVERNMENT PRO.SBI	24 258	437 486 €
GPE BRUXEL.LAMBERT	222 760	14 864 775 €
GPE EUROTUN.REGPT	710 029	5 424 622 €
GRAFTON UNIT	144 985	1 127 467 €
GRAINCORP	46 858	258 598 €
GRAINGER	131 439	321 962 €
GRAINGER (W.W.)	2 431	450 632 €
GRANITE REAL ESTAT	23 311	615 555 €
GREAT EAGLE HOLD.	58 589	145 591 €
GREAT PORTL.ESTAT.	161 478	1 162 564 €
GREAT-WEST LIFECO	18 962	424 170 €
GREE INC	85 100	610 501 €
GREEK ORG.FOOTBALL	275 900	2 667 953 €
GREEN MTN COFFEE	9 266	507 986 €
GREEN REIT PLC	1 061 912	1 531 277 €
GRENKELEASING	27 536	1 872 448 €
GRIFOLS	381 307	13 256 138 €
GRIFOLS SA - B	8 202	212 309 €
GROUPE BOURBON	142 953	2 859 060 €
GROUPE CGI CL.A	22 391	543 544 €
GROUPE DANONE	775 381	40 567 934 €
GROUPE FNAC DA13	5	13 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
GRYPHON MINERALS	63 528	7 012 €
GUNNS LIMITED	161 123	- €
GUOCOLEISURE	101 465	50 155 €
GWA GROUP LTD	70 781	139 705 €
GZI REIT	397 375	140 587 €
H.I.S. CO LTD	19 600	710 488 €
HALLIBURTON	280 556	10 333 273 €
HALMA	1 540 042	11 170 858 €
HAMBORNER	11 329	83 121 €
HAMMERSON	297 610	1 795 676 €
HANG LUNG GROUP	187 314	686 366 €
HANG LUNG PROP. T.	1 490 415	3 417 647 €
HANG SENG BANK	175 174	2 060 909 €
HANNOVER RUCK.NOM.	103 362	6 447 722 €
HANSTEEN HOLDINGS	359 289	467 248 €
HARGREAVES LANSDOWN	400 000	6 509 615 €
HARLEY-DAVIDSON	58 209	2 925 024 €
HARMAN INTL IND.	9 224	547 924 €
HARRIS	22 002	1 114 711 €
HARTFORD FINANCIAL	14 846	390 355 €
HARVEY NORMAN	116 126	238 254 €
HASBRO	8 861	353 758 €
HASEKO	36 000	198 854 €
HAVAS ADVERTISING	1 716 240	10 269 980 €
HCA HOLDINGS	19 395	671 555 €
HCP	227 849	6 005 861 €
HEALTH CARE REIT	176 853	6 875 691 €
HEALTH CARE RLTY T	39 900	617 076 €
HEIDELBERGCEMENT	141 830	7 821 925 €
HEINEKEN	290 879	14 276 341 €
HEINEKEN HOLDING	167 477	7 701 430 €
HELICAL BAR	19 355	75 954 €
HELLENIC PETROLEUM	123 019	932 484 €
HELLENIC TELECOM.	543 406	5 254 736 €
HENDERSON INVEST.	197 000	11 432 €
HENDERSON LAND	692 205	2 866 830 €
HENG TAI	1 062 054	17 594 €
HENKEL PF	155 247	13 088 875 €
HENKEL POR	140 769	10 647 767 €
HENNES MAURITZ S.B	85 932	2 876 052 €
HERBALIFE	8 822	503 876 €
HERMES INTL	46 351	12 213 489 €
HERSHA CL.A SBI	75 372	304 683 €
HERSHEY FOODS	136 781	9 651 801 €
HERTZ GLBL HDGS	18 284	379 772 €
HESS	12 835	773 137 €
HEWLETT PACKARD	78 484	1 593 717 €
HEXAGON B	88 042	2 022 479 €
HIGHWOODS PROP.	35 495	931 747 €
HIKARI TSUSHIN	7 400	405 178 €
HIKMA PHARMACEUT.	285 500	4 121 220 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
HILL & SMITH HLDGS	670 341	4 153 375 €
HILLS INDUSTRIES	55 367	62 549 €
HILLSHIRE BRANDS	39 991	970 534 €
HINO MOTORS	166 000	1 893 475 €
HI-P INTERNATIONAL	44 400	14 929 €
HITACHI	945 000	5 193 813 €
HITACHI CHEMICAL	48 100	556 954 €
HITACHI HIGH-TECH.	39 300	716 642 €
HITACHI TRANSPORT	154 100	1 670 490 €
HKG AND CHINA GAS	1 291 727	2 149 594 €
HKG EXCHANGES	263 408	3 187 729 €
HKG LAND HOLD.	766 328	3 281 323 €
HKR INTERNATIONAL	151 736	51 126 €
HO BEE INVESTMENT	55 437	67 552 €
HOCHTIEF	26 806	1 663 580 €
HOLCIM NOM.	25 510	1 389 468 €
HOLLYFRONTIER	16 737	603 572 €
HOME DEPOT	266 502	15 925 520 €
HOME PROPERTIES	22 990	894 640 €
HONDA MOTOR	539 600	16 132 486 €
HONEYWELL INTL	79 437	5 267 551 €
HONG LEONG ASIA	30 226	23 193 €
HONGHUA GROUP	384 882	94 020 €
HONGKONG ELECTRIC	303 397	1 750 646 €
HOPEWELL HOLDINGS	124 981	307 063 €
HOPEWELLE HIGHWAY	207 781	71 761 €
HORIZON OIL LTD	292 233	57 870 €
HORMEL FOODS	89 622	2 937 968 €
HOSPIRA	10 413	311 959 €
HOSPITALIT.PROP.PB	89 484	1 755 390 €
HOST HOTELS	371 437	5 240 391 €
HR REAL ESTATE	112 722	1 647 656 €
HSBC HOLDINGS	2 759 534	21 970 136 €
HUABAO INTERNATIONAL	428 607	172 096 €
HUDSON CITY	87 906	601 606 €
HUDSON PACIFIC PRO	19 030	302 044 €
HUFVUDSTADEN LIB.A	399 260	3 886 582 €
HUGO BOSS	26 645	2 757 758 €
HUHTAMAKI	609 958	11 375 717 €
HULIC	130 000	1 395 774 €
HUMANA	14 049	1 052 426 €
HUNT TRANSPORT SCE	7 952	446 106 €
HUNTING	206 708	1 937 888 €
HUNTINGTON BANCSH.	47 604	333 390 €
HUSKY ENERGY	9 371	215 705 €
HUTCH.HARBOUR RING	566 600	32 879 €
HUTCH.WHAMPOA ORD	547 585	5 401 894 €
HUTCHINSON TELEC	277 781	76 437 €
HUTCHISON PORT HOL	1 148 152	562 452 €
HYFLUX	123 320	82 932 €
HYSAN DEVELOPMENT	416 756	1 302 814 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
I.T LIMITED	110 409	20 668 €
IAC INTERACTIVE CORP	11 453	570 622 €
IAMGOLD	16 251	39 183 €
IBERDROLA	2 859 978	13 255 998 €
IBM	46 455	6 323 800 €
ICADE	120 031	8 122 498 €
IG GROUP HOLDINGS	480 000	3 553 846 €
IGM FINANCIAL	9 481	363 232 €
IHI	1 108 000	3 473 258 €
IHS CL.A	10 886	945 681 €
IINET	31 130	131 578 €
ILIAD	74 960	11 161 544 €
ILLINOIS TOOL WRK	13 196	805 225 €
ILLUMINA	13 847	1 111 358 €
ILUKA RESOURCES	96 041	538 134 €
IMDEX	46 830	18 851 €
IMERYS	59 809	3 780 527 €
IMI	244 648	4 484 233 €
IMMOAEST NV	1 227 354	- €
IMMOBILIARE GRANDE	48 422	41 885 €
IMMOFINANZ	1 563 165	5 264 740 €
IMMOFINANZ DA10	720 883	- €
IMPERIAL TOBACCO	404 065	11 354 615 €
IMPLENIA	154 632	8 207 925 €
INBEV	620 412	47 933 031 €
INCITEC PIVOT	371 048	645 636 €
IND&INFRA FD INVST	62	375 433 €
INDEPENDENCE GROUP	51 812	104 620 €
INDITEX	231 503	27 734 059 €
INDOFOOD AGRI RES.	93 024	47 319 €
INDOPHIL RESOURCES	162 339	17 391 €
INFIGEN ENERGY	157 397	26 570 €
INFINEON TECHN.	773 163	5 999 745 €
INFORMA	611 767	4 216 928 €
INFRATIL	96 522	130 871 €
ING GROEP	3 033 756	30 640 936 €
ING OFFICE FUND	437 132	888 341 €
ING U.S.	8 919	227 522 €
ING UK REAL ESTATE	54 992	37 014 €
INGENICO	184 839	10 772 417 €
INGERSOLL-RAND	152 031	6 796 654 €
INLAND REAL ESTATE	38 287	292 314 €
INNVEST REAL ESTATE	15 910	50 749 €
INPEX HOLDINGS	351 600	3 272 504 €
INSPUR INTL	220 783	31 823 €
INSUR.AUSTRAL.GRP	475 216	1 795 713 €
INTACT FINANCIAL	54 631	2 588 540 €
INTEGRATED WASTE HLG	360 000	- €
INTEL	125 024	2 355 032 €
INTER PARFUMS	72 000	2 257 200 €
INTERCONTINENTAL HOT	78 400	1 896 865 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
INTERCONTINENTALEX	3 589	585 846 €
INTERMEDIATE CAP.	632 918	3 195 019 €
INTERPUBLIC GROUP	197 690	2 539 454 €
INTERROLL HOLD.NOM	6 677	2 669 710 €
INTERTEK GROUP	161 077	6 094 596 €
INTERVEST OFFICES	2 713	52 849 €
INTESA SANPAOLO	7 885 007	14 145 703 €
INTL FLAVORS	5 674	354 054 €
INTL GAME TECHN.	17 061	224 855 €
INTL PAPER	437 482	15 566 981 €
INTREPID MINES	124 466	25 456 €
INTUIT	238 561	13 213 568 €
INTUITIVE SURGICAL	1 273	354 840 €
INVESCO	15 290	403 916 €
INVESTORS REAL ESTA	45 056	280 558 €
INVOCARE	25 321	181 498 €
IOOF HOLDINGS	53 411	310 715 €
IPSEN PROMESSE	54 616	1 876 879 €
IRESS MKT TECHN.	29 298	179 570 €
IRISH CONT. UNIT	47 356	1 255 881 €
IRON MOUNTAIN	15 243	335 746 €
ISETAN MITSUKOSHI	206 400	2 130 553 €
ITE GROUP	595 634	2 198 548 €
ITOCHE	161 700	1 450 309 €
ITRON	28 752	864 501 €
ITV	410 000	956 010 €
IZUMI CO LTD	35 800	815 715 €
J.HARD.CHESS UNITS	100 510	844 435 €
JABIL CIRCUIT	12 371	156 579 €
JACOBS ENGINEERING	6 313	288 596 €
JAP.REAL EST.REIT	518	2 017 206 €
JAP.RET.FD REIT	912	1 348 826 €
JAPAN AIRLINES CO	96 600	3 461 672 €
JAPAN EXCEL.REIT	450	383 104 €
JAPAN LOGISTICS	66	508 113 €
JAPAN PRIME REIT	349	812 076 €
JAPAN STEEL WORKS	420 000	1 705 172 €
JAPAN TOBACCO	353 000	8 335 704 €
JARDIN.MATHES.HOLD	54 911	2 084 617 €
JARDINE CYCLE	23 383	483 170 €
JARDINE STRATEGIC	133 356	3 097 026 €
JB HI-FI	22 932	320 113 €
JCDECAUX	108 134	3 240 776 €
JEOL	34 000	116 909 €
JERON.MARTINS ESC.	563 563	8 011 048 €
JFE HOLDINGS	196 000	3 385 984 €
JGC	67 000	1 908 272 €
JIN CO LTD	12 600	387 144 €
JM AB	250 000	5 127 119 €
JOHN WOOD CONSO	173 733	1 432 462 €
JOHNSON CONTROLS	54 489	2 028 656 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
JOHNSON ELECTRIC	327 809	230 110 €
JOHNSON JOHNSON	468 141	31 117 668 €
JOHNSON MATTHEY PL	119 196	4 699 073 €
JOY GLOBAL	7 372	312 931 €
JPMORGAN CHASE	555 842	23 590 711 €
JS GROUP	105 800	2 106 065 €
JSR	471 500	6 628 281 €
JU TENG INTERNATIONA	193 873	93 087 €
JUNIPER NETWORKS	36 763	602 178 €
JUPITER FUND MANAG	1 550 000	7 172 476 €
JYSKE BANK	55 315	2 168 765 €
K REIT ASIA REIT	1 020 629	695 163 €
K S HOLDINGS	36 400	764 041 €
K&S NOM	147 230	3 294 271 €
K.WAH INTL HOLD.	234 827	103 300 €
KABEL DEUTSCHLAND	71 705	6 756 045 €
KADOKAWA GROUP	19 600	483 132 €
KAGARA	142 178	- €
KAJIMA	424 000	1 156 390 €
KAKAKU.COM	167 700	2 138 658 €
KAKEN PHARMA.	45 000	490 920 €
KAMIGUMI	110 000	732 169 €
KANAMOTO	44 000	812 069 €
KANSAI ELEC.POW.	207 700	1 733 821 €
KANSAS CITY SOUTHN	4 566	410 340 €
KAROON GAS AUSTRALIA	48 105	135 551 €
KATHMANDU HOLDINGS	46 830	98 180 €
KAWASAKI KISEN	901 000	1 654 809 €
KBC BANCASSURANCE	280 254	11 560 478 €
KCOM GROUP	4 049 707	4 782 256 €
KDDI	172 700	7 715 038 €
KELLOGG	53 577	2 374 590 €
KENE.REA.INV.REIT	127	438 007 €
KEPPEL	327 254	2 104 824 €
KEPPEL LAND	503 433	966 471 €
KEPPEL TEL	22 023	19 494 €
KERING	149 039	22 899 842 €
KERRY GROUP CL.A	320 853	16 203 077 €
KERRY LOGISTIC	73 484	75 793 €
KERRY PROPERTIES	430 658	1 084 273 €
KESKO CL.B	103 259	2 767 341 €
KEYCORP	51 793	504 436 €
KILLAM PROPERTIES	13 331	95 426 €
KILROY REALTY CORP	33 179	1 208 304 €
KIMBERLY CLARK	62 304	4 723 330 €
KIMCO REALTY	212 336	3 043 498 €
KINDER MORGAN	100 514	2 626 101 €
KINDER MORGAN MGNT	46 303	2 542 481 €
KINEPOLIS GROUP	8 790	1 011 729 €
KINGFISHER	182 000	841 531 €
KINGROSE MINING LT	51 209	11 138 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
KINGSGATE CONSOL.	25 666	15 498 €
KINGSPAN GROUP	482 821	6 276 673 €
KINNEVIK INVEST.B	30 000	1 009 831 €
KINROSS GOLD	317 137	1 007 266 €
KINTETSU WORLD EXP	84 600	2 470 883 €
KION GROUP	24 612	756 204 €
KITE REALTY GP TRUST	62 235	296 744 €
KITZ	27 600	100 620 €
KIWI INCOME	600 249	387 211 €
KLA TENCOR	6 037	282 419 €
KLEPIERRE	184 353	6 209 931 €
KLOEVERN	21 107	67 972 €
KOA	49 300	367 291 €
KOHL S	14 969	616 511 €
KOMATSU	254 500	3 755 206 €
KOMERI	54 400	1 010 398 €
KON.BOSKALIS	55 231	2 121 147 €
KON.DSM NOM.	150 931	8 627 216 €
KON.PHILIPS ELEC.	686 880	18 301 918 €
KONAKA	23 900	154 625 €
KONE B	359 137	11 779 694 €
KONECRANES A	94 328	2 439 322 €
KONICA	231 000	1 673 127 €
KONINKLIJKE AHOLD	955 711	12 472 029 €
KONINKLIJKE KPN	2 508 573	5 877 587 €
KONINKLIJKE VOPAK	58 308	2 479 256 €
KOWLOON DEV CO	77 584	69 347 €
KRAFT FOODS GROUP	16 720	654 166 €
KROGER	48 714	1 397 536 €
KRONES HERMANN ORD	94 056	5 871 916 €
KUBOTA	359 000	4 310 578 €
KUEHNE UND NAGEL	38 875	3 714 616 €
KUNGSLEDEN	46 948	229 170 €
KWS SAAT	15 500	3 875 000 €
KYOKUTO KAIHATSU	25 400	237 988 €
KYOWA EXEO	22 200	213 064 €
LABORATORIOS ALM.	26 796	317 265 €
LABORATORY AMERICA	31 867	2 113 134 €
LAFARGE	219 784	11 971 634 €
LAFARGE PRIME FID.	60 000	3 268 200 €
LAGARDERE	169 869	4 589 860 €
LAI SUN DEVELOPMEN	2 344 735	46 086 €
LAM RESEARCH	84 638	3 344 611 €
LAND SECURITIES	1 260 007	14 591 547 €
LANGHAM HOSPITALIT	196 970	68 580 €
LANXESS	68 377	3 314 575 €
LAS VEGAS SANDS	83 675	4 789 497 €
LASALLE HOTEL	42 126	943 471 €
LASSILA AND TIKAN.	13 100	199 513 €
LAUDER ESTEE CL.A	192 229	10 507 793 €
LEAR CORP	171 210	10 060 871 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
LEASINVEST REAL	705	51 888 €
LEG IMMOBILIEN	13 946	598 981 €
LEGAL GL GROUP	355 000	950 222 €
LEGG MASON	6 408	202 206 €
LEGGETT AND PLATT	8 275	185 811 €
LEGRAND PROMESSES	337 507	13 520 530 €
LEIDOS HOLDINGS	15 713	530 153 €
LEIGHTON HOLDINGS	33 913	354 719 €
LEM HDG SA REGISTER	5 751	3 275 559 €
LEND LEASE	123 568	893 746 €
LENNAR CL.A	13 200	378 977 €
LENZING	26 723	1 112 612 €
LEUCADIA NATIONAL	16 761	344 732 €
LEXINGTON REALTY	93 670	694 078 €
LI AND FUNG LTD	1 318 753	1 234 291 €
LIBERTY GLOBAL CL A	153 236	9 377 211 €
LIBERTY GLOBAL INC-A	11 277	728 393 €
LIBERTY INTERACT.	42 196	898 797 €
LIBERTY INTERACTIVE	2 564	228 116 €
LIBERTY INTL	321 856	1 198 836 €
LIBERTY MEDIA CAP A	120 887	12 834 604 €
LIBERTY PROP.PB	78 991	1 941 669 €
LIFE TECHNOLOGIES CO	15 550	855 425 €
LIFESTYLE INTL	107 311	144 229 €
LIMITED BRANDS NV	9 322	418 438 €
LINC ENERGY	67 886	59 310 €
LINCOLN NATIONAL	10 239	383 582 €
LINDE	146 542	22 281 711 €
LINEAR TECHNOLOGY	8 577	283 535 €
LINKEDIN A	3 306	520 241 €
LION SELESECTION GRP	10 477	272 €
LIONGOLD CORP LTD	205 747	20 104 €
LIPPO-MAPLETREE REAL	398 945	95 162 €
LISI	11 511	1 240 886 €
LKQ	27 098	647 017 €
LLOYDS TSB GROUP	3 638 415	3 449 497 €
LOBLAW	5 990	173 393 €
L'OCCITANE INTL	102 473	158 251 €
LOEW'S	9 712	340 015 €
LONDON & STAMFORD	325 372	540 853 €
LOOMIS	325 000	5 600 282 €
LORILLARD	22 950	844 115 €
LOTTOMATICA	184 202	4 081 916 €
LOWES	36 429	1 310 006 €
L'SEA RESSOURCES	807 071	34 747 €
LSI	754 457	6 042 117 €
LTC PROPERTIES	15 199	390 371 €
LUK FOOK	72 274	199 553 €
LULULEMON ATHLETIC	9 334	399 874 €
LUXOTTICA GROUP	275 950	10 748 253 €
LVMH MOET VUITTON	312 894	41 489 744 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
LYNAS COPORATION	430 654	82 485 €
LYONDELLBASELL IND	149 062	8 684 736 €
M AND T BANK	3 911	330 444 €
M.D	18 440	33 523 €
M.G.I	144 993	95 551 €
M2 TELECOM	39 606	161 232 €
MACAU LEGEND DEVEL	199 834	152 434 €
MACERICH	69 158	2 955 740 €
MACK CALI REALTY	38 781	604 555 €
MACMAHON	215 390	20 278 €
MACQUARIE ATLAS ROAD	90 115	160 899 €
MACQUARIE GROUP	73 421	2 620 408 €
MACY S	348 512	13 506 452 €
MAGNA INTL CL.A	7 362	437 984 €
MAINFREIGHT	11 453	81 885 €
MAKITA	92 300	3 517 890 €
MAN ORD.	51 744	4 618 152 €
MAN WAH HOLDINGS	61 395	69 760 €
MANPOWER	4 762	296 731 €
MANULIFE FINANCIAL	48 922	700 389 €
MAPFRE	809 099	2 518 725 €
MAPLETREE COMMERC	855 972	585 473 €
MAPLETREE GREATER	410 797	198 339 €
MAPLETREE INDUSTRI	778 263	597 184 €
MAPLETREE LOGISTICS	958 752	581 379 €
MARATHON OIL	289 808	7 424 503 €
MARATHON PETROLEUM	9 838	654 938 €
MARKEL	856	360 534 €
MARKS SPENCER GRP	100 000	519 952 €
MARRIOTT INTL CL.A	10 503	376 176 €
MARSH MC LENNAN	135 816	4 766 719 €
MARUBENI	163 000	850 846 €
MARVELL TECHNOLOGY	66 478	693 776 €
MASCO	26 160	432 298 €
MASTERCARD CL.A	25 741	15 607 501 €
MATSUSH.ELEC.IND.	215 000	1 817 027 €
MATTEL	16 828	581 084 €
MAXIM INTEGRATED	11 577	234 413 €
MAYR-MELNHOF	31 000	2 790 000 €
MAZDA MOTOR	1 649 000	6 193 855 €
MC CORMICK NON VTG	59 057	2 953 922 €
MC GRAW HILL ORD.	18 323	1 039 886 €
MCDERMOTT INTL	11 570	76 915 €
MCDONALDS	90 969	6 405 924 €
MCKESSON	211 257	24 745 540 €
MCMILLAN SHAKESPEA	11 792	90 419 €
MDU RESOURCES GRP	9 755	216 282 €
MEAD JOHNSON NUTRI	110 747	6 732 106 €
MEADWESTVACO	9 487	254 267 €
MEDIASET	550 067	1 895 531 €
MEDICA	136 504	2 590 846 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
MEDICX FUND LTD	37 719	38 082 €
MEDINET	2 035	601 381 €
MEDIOBANCA	391 854	2 492 191 €
MEDIOLANUM	896 991	5 651 043 €
MEDTRONIC	74 281	3 093 829 €
MEDUSA MINING	46 164	61 144 €
MEG ENERGY CORP	7 672	160 404 €
MEGMILK SNOW BRAND	35 600	325 692 €
MEITEC	87 700	1 724 571 €
MEKONOMEN AB	279 028	6 242 660 €
MELCO INTL DEV.	183 630	489 827 €
MELLANOX TECHN.	4 155	120 528 €
MERCIALYS	18 570	283 193 €
MERCK AND CO. NEW	194 475	7 063 991 €
MERCK KGAA	137 929	17 965 252 €
MERLIN ENTERTAINMENT	562 824	2 418 384 €
MERMAID MARINE	52 228	115 294 €
MESOBLAST	40 921	155 426 €
MESSAGE	23 700	531 012 €
METCASH	202 212	414 875 €
METLIFE	207 777	8 130 732 €
METRO	6 410	284 149 €
METRO	129 755	4 567 376 €
METRO HOLDINGS	100 853	48 693 €
METSO	104 466	3 240 535 €
MGM CHINA HOLDINGS	175 137	542 575 €
MGM MIRAGE	23 535	401 730 €
MICHAEL KORS HOLD	6 892	406 097 €
MICHAEL PAGE INTL	710 000	4 164 423 €
MICHELIN	325 665	25 157 621 €
MICROCHIP TECHN.	11 247	365 268 €
MICRON TECHNOLOGY	54 344	857 814 €
MICROPORT SCIENTIF	94 794	44 982 €
MICROSOFT	581 936	15 799 569 €
MID AMERICA APARTM	31 387	1 383 588 €
MIDAS HOLDINGS	205 243	60 164 €
MIDLAND HOLD	110 000	38 402 €
MIGHTY RIVER POWER	160 325	203 973 €
MINCOR RESOURCES	31 657	12 230 €
MINEBEA	168 000	892 025 €
MINERAL RESOURCES	31 906	245 893 €
MINTH GROUP	138 326	208 441 €
MIRABELA NICKEL	181 247	- €
MIRVAC GROUP	2 444 893	2 666 810 €
MITSU.UFJ LEASE	382 900	1 705 244 €
MITSUB.ELECTRIC	1 136 000	10 353 656 €
MITSUBISHI	133 200	1 855 033 €
MITSUBISHI ESTATE	603 775	13 111 043 €
MITSUBISHI GAS	241 000	1 287 951 €
MITSUBISHI MATER.	309 000	827 812 €
MITSUBISHI TOKYO	4 658 750	22 323 914 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
MITSUI	584 500	5 912 397 €
MITSUI FUDOSAN	504 408	13 182 243 €
MITSUI MINING	599 000	1 335 890 €
MITSUI OSK	567 000	1 855 679 €
MITSUI SUMITOMO	122 200	2 381 056 €
MITSUI-SOKO	250 000	842 367 €
MIZUHO FCIAL GRP	4 504 600	7 091 409 €
MOBILEONE	68 125	128 043 €
MOBIMO	2 739	415 935 €
MOHAWK INDUSTRIES	3 205	346 342 €
MOLSON COORS CL.B	25 591	1 042 844 €
MONADELPHOUS GROUP	19 626	237 011 €
MONDELEZ INTL	369 379	9 463 008 €
MONEYSUPERMKT.COM	740 841	1 608 124 €
MONGOLIA ENERGY	958 501	21 800 €
MONGOLIAN MINING	141 559	13 647 €
MONSANTO	151 846	12 843 930 €
MONSTER BEVERAGE	8 958	440 586 €
MOODY S	18 294	1 041 825 €
MORGAN STANLEY	49 112	1 117 753 €
MORGUARD REAL	7 202	80 921 €
MORI HILLS REIT	89	428 930 €
MORI TRUST SOGO	80	462 888 €
MOTOROLA SOLTN-ED	44 014	2 156 140 €
MPW US	66 148	586 638 €
MTR	318 110	873 855 €
MTU AERO ENGINES	190 061	13 568 455 €
MUCKLOW AJ GROUP	5 419	31 198 €
MUNCHENER RUCKVERS	120 935	19 367 740 €
MURATA MFG	67 900	4 378 830 €
MURPHY OIL	12 614	593 945 €
MYER HOLDINGS	133 331	238 060 €
MYLAN	193 796	6 104 033 €
N.E	250 414	11 381 €
NABORS INDUSTRIES	11 747	144 845 €
NAGACORP	303 743	232 264 €
NANOCARRIER	550	868 501 €
NAT.AUSTRALIA BANK	526 150	11 898 328 €
NAT.BANK CANADA	8 481	512 029 €
NAT.HEALTH INVTR	10 836	441 178 €
NATEXIS BQ.POPUL.	1 465 514	6 263 607 €
NATIONAL GRID TRAN	966 186	9 150 896 €
NATIONAL OILWELL	17 919	1 034 254 €
NATIONAL RETAIL PRO	51 327	1 129 797 €
NATUREX	29 000	1 690 410 €
NAVITAS	64 478	269 182 €
NAW WORLD DEVELOP.DS	31 367	- €
NCC GROUP PLC	3 300 000	7 337 740 €
NCR	19 206	474 749 €
NEO-NEON HOLDINGS	107 637	17 731 €
NEOPOST	70 000	3 921 400 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
NEPTUNE ORIENT	206 750	133 690 €
NESTE OY	111 938	1 608 549 €
NESTLE NOM.	299 265	15 946 148 €
NET ENTERTAINMENT B	236 000	3 613 333 €
NETAPP	410 833	12 266 253 €
NETFLIX INC	4 547	1 214 942 €
NEW GOLD	81 619	309 963 €
NEW HOPE CORP.	57 549	124 424 €
NEW OCEAN ENERGY	198 765	117 760 €
NEW WORLD CHINA LD	1 404 324	492 893 €
NEW WORLD DEV.	2 557 589	2 343 513 €
NEW WORLD DPT	113 687	46 393 €
NEW YORK COMMUNITY	23 405	286 214 €
NEW ZEALAND O&G	77 139	37 090 €
NEWCREST MING	175 133	886 922 €
NEWELL RUBBERMAID	37 000	870 288 €
NEWFIELD EXPLOR.	7 158	127 949 €
NEWMONT MINING	214 980	3 593 141 €
NEWS CL.A	265 868	3 476 988 €
NEWS CORP - CLASS B	8 406	108 773 €
NEXT GROUP	46 227	3 028 091 €
NEXTERA ENERGY INC	38 460	2 389 829 €
NHK SPRING	238 000	1 948 961 €
NIBE INDUSTRIER B	180 000	2 949 153 €
NICHICON	193 600	1 360 801 €
NIDEC	141 000	10 027 619 €
NIELSEN HOLDINGS	42 870	1 427 756 €
NIEUWE STEEN INV	39 424	181 350 €
NIHON PARKERIZING	118 000	1 788 373 €
NIHON UNISYS	142 200	906 239 €
NIKE CL.B	209 109	11 934 343 €
NIP.BUILD.FD REIT	552	2 332 555 €
NIPPON ACCOMMODATI	98	479 072 €
NIPPON PROLOGIS RE	104	722 392 €
NIPPON SHINYAKU	44 000	622 495 €
NIPPON SHOKUBAI	63 000	505 462 €
NIPPON STEEL	1 952 000	4 744 210 €
NIPPON TELEG.TEL.	89 700	3 505 503 €
NISHIMATSU CONST.	754 000	1 738 839 €
NISOURCE	14 255	340 159 €
NISSAN MOTOR	489 200	2 985 934 €
NITTO DENKO	129 200	3 956 376 €
NITTOC CONSTRUCTIO	125 000	343 506 €
NKSJ HOLDINGS 1 SEC	207 400	4 187 237 €
NOBIA	1 645 955	10 136 107 €
NOBLE CORPORATION	16 202	440 590 €
NOBLE ENERGY	19 242	951 138 €
NOBLE GROUP	877 514	539 683 €
NOKIA	3 982 980	23 180 944 €
NOKIAN RENKAAT	95 228	3 320 600 €
NOMURA HOLDINGS	1 022 300	5 710 424 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
NOMURA REAL ESTATE	860	643 679 €
NOMURA REAL REIT	177	597 618 €
NOMURA RL ESTATE	259 041	4 235 373 €
NORDEA BANK	380 977	3 730 131 €
NORDSTROM	5 599	251 120 €
NORFOLK SOUTHERN	112 103	7 552 450 €
NORMA GROUP AG	60 865	2 196 314 €
NORTHEAST UTIL.	15 853	487 705 €
NORTHERN PPTY STP UT	12 469	236 341 €
NORTHERN STAR RES	87 664	44 680 €
NORTHERN TRUST	8 269	371 412 €
NORTHWEST HEALTHCA	5 989	42 707 €
NORWEGIAN PROPERTY	196 172	170 597 €
NOVARTIS	456 518	26 523 118 €
NOVO-NORDISK B	100 345	13 369 828 €
NOVOZYMES B NV	284 186	8 719 512 €
NRG ENERGY	26 182	545 720 €
NRW HOLDINGS	57 348	51 011 €
NTT URBAN DEV.	48 200	402 360 €
NUANCE CIONS INC.	16 125	177 879 €
NUCOR	10 300	399 023 €
NUFARM	40 841	116 408 €
NUFLARE TECHNOLOGY	9 200	829 607 €
NUMERICABLE GROUP	41 406	1 093 118 €
NUPLEX INDUSTRIES	44 653	90 682 €
NUTRECO NV	91 988	3 321 687 €
NVIDIA	55 170	641 428 €
NVR	401	298 592 €
NWS HOLDINGS	309 014	341 861 €
NXP SEMICONDUCTORS	77 138	2 571 267 €
O REILLY AUTOMOT.	30 542	2 852 936 €
OAKTON	17 522	18 202 €
OCCIDENTAL PETROL.	308 383	21 284 000 €
OCEANS WILSONS	185 000	2 318 059 €
OCEANUS GROUP LTD	430 725	5 942 €
OCI NV	55 303	1 810 344 €
OIL SEARCH	261 450	1 376 678 €
OKUMA	253 000	2 024 629 €
OLAM INTERNATIONAL	322 946	284 931 €
OLD MUTUAL	11 594	26 351 €
OLD REP.INTL ORD.	26 619	333 631 €
OLYMPUS OPTICAL	84 800	1 949 762 €
OM HLGDS LTD	113 513	23 953 €
OMEGA HEALTHCARE	51 098	1 105 102 €
OMNICARE	183 389	8 033 500 €
OMNICOM GROUP	8 904	480 579 €
OMV	169 343	5 891 443 €
ON SEMICONDUCTOR	669 900	4 006 079 €
ONEOK	11 442	516 339 €
ONWARD HOLD.	75 000	412 725 €
OPERA SOFTWARE	1 127 082	11 183 322 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
ORACLE	530 176	14 721 340 €
ORANGE	2 339 909	21 059 181 €
OREAL	412 048	52 618 530 €
ORICA	83 500	1 293 540 €
ORIENT OVERSEAS	46 007	167 720 €
ORIENTAL PRESS GRP	70 500	5 873 €
ORIGIN ENERGY	249 165	2 276 166 €
ORION CL.B	31 032	633 673 €
ORIX	989 800	12 622 803 €
ORIX JREIT REIT	1 885	1 714 110 €
ORORA LTD	276 833	208 496 €
ORPEA	67 405	2 847 187 €
OSAKA SEC.EXCHANGE	102 900	2 123 649 €
OSIM INTERNATIONAL	51 026	67 456 €
OSRAM LICHT AG	54 349	2 228 309 €
OTSUKA	39 600	3 666 616 €
OUE HOSPITALITY TR	158 849	79 890 €
OUTOTEC	610 000	4 642 100 €
OVERS.CHINESE BKG	620 654	3 638 735 €
OVERSEAS UNION ENT	62 351	89 595 €
OWENS-ILLINOIS	9 813	254 815 €
OXFORD INSTRUMENTS	139 668	2 966 266 €
OZ MINERALS	70 008	143 180 €
P.P.G.INDUSTRIES	4 600	633 164 €
PACCAR	11 848	508 779 €
PACIFIC ANDES RES	333 000	25 265 €
PACIFIC BASIN	397 000	206 223 €
PACIFIC BRANDS	205 177	85 257 €
PACIFIC TEXTILES	96 615	107 247 €
PADDY POWER	34 800	2 157 600 €
PALADIN ENERGY	202 844	61 240 €
PALL	75 615	4 683 751 €
PANAUST LTD	138 832	162 701 €
PANDORA	192 113	7 570 905 €
PANORAMIC RES.	40 876	6 635 €
PAPILLON RESOURCES	74 212	47 220 €
PARAMOUNT BED HDG	11 800	287 199 €
PARK24	83 900	1 148 752 €
PARKER-HANNIFIN	67 364	6 289 067 €
PARKSON RETAIL GROUP	315 371	70 546 €
PARKWAY LIFE REAL	86 533	116 883 €
PARKWAY PROPERTIES	30 941	433 161 €
PARMALAT	547 943	1 356 707 €
PARTNERRE	16 656	1 274 434 €
PARTNERS GROUP NOM	49 616	9 631 698 €
PATTERSON CIES	16 194	484 210 €
PATTERSON-UTI	23 070	423 929 €
PAYCHEX	146 612	4 844 506 €
PCCW	898 596	291 842 €
PCFIC RUB EGY	19 234	240 942 €
PEABODY ENERGY	17 023	241 280 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
PEARSON	623 849	10 055 066 €
PEBBLEBROOK HOTEL	30 646	684 136 €
PEMBINA PPLN INC TR	56 819	1 452 250 €
PENN REAL ESTATE	28 401	391 212 €
PENN WEST ENERGY	20 449	123 891 €
PENNEY (J.C.)	19 009	126 230 €
PENTA OCEAN CONST.	392 000	998 743 €
PENTAIR LTD	8 908	502 130 €
PEOPLES UNITED	100 841	1 106 551 €
PEPCO HOLDINGS	13 424	186 371 €
PEPSICO	357 416	21 513 958 €
PEPTIDREAM INC	12 100	1 159 622 €
PERENNIAL CHINA RE	128 570	39 167 €
PERKINELMER	7 200	215 441 €
PERNOD-RICARD	277 795	23 004 204 €
PERPETUAL	8 702	272 665 €
PERRIGO COMPANY	28 928	3 221 780 €
PERSEUS MINING	100 792	16 033 €
PERSIMMON	333 000	4 958 978 €
PETROLIERE IMP.	8 505	273 266 €
PETSMART	10 009	528 453 €
PEUGEOT S.A.	343 031	3 237 527 €
PFEIFFER VACUUM	81 761	8 088 616 €
PFIZER	1 476 222	32 815 647 €
PG AND E	259 569	7 587 952 €
PHILIP MORRIS	53 956	3 411 849 €
PHILLIPS 66	226 524	12 680 018 €
PIEDMONT OFFICE REAL	64 754	776 352 €
PINNACLE WEST	5 718	219 607 €
PIONEER NAT.RES.	5 010	669 273 €
PIRELLI & C	236 055	2 969 572 €
PKC GROUP	92 311	2 233 003 €
PLATINUM AM	51 615	230 897 €
PLUM CREEK TIMBER	11 474	387 296 €
PMS	26 498	60 215 €
PNC FIN.SCES GROUP	14 614	822 813 €
POLYTEC ASSET	255 000	23 628 €
PORSHE AUTOMOBILE	124 165	9 394 324 €
PORTS DESIGN	73 477	41 263 €
PORTUGAL TELE.NOM.	507 585	1 603 969 €
POST PROPERTIES	23 892	784 262 €
POSTNL NV	1 610 493	6 683 546 €
POTASH SASKATCHEW.	36 108	863 701 €
POU SHENG INTL HDG	455 457	17 051 €
POWER CORP.CANADA	11 661	254 478 €
POWER FINANCIAL	8 558	210 435 €
PPL	73 751	1 610 543 €
PRADA	117 809	760 819 €
PRAXAIR	32 473	3 064 420 €
PREC.CASTPARTS	5 611	1 096 627 €
PREMER INVT LTD	18 634	99 207 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
PREMIER INVESTMENT	85	238 866 €
PREMIER OIL	150 000	565 385 €
PRI HEALTH CARE	108 083	347 365 €
PRICE T ROWE GROUP	7 507	456 391 €
PRICELINE.COM	8 316	7 015 399 €
PRIMARY HEALTH	42 949	182 224 €
PRIME OFFICE AG	14 335	44 295 €
PRINCIPAL FCIAL	10 722	383 701 €
PROCTER GAMBLE	135 801	8 023 485 €
PROGRESSIVE	30 992	613 362 €
PROLOGIS	231 322	6 203 170 €
PROSAFE	279 000	1 561 885 €
PROSEGUR	1 100 000	5 478 000 €
PROSIEBEN NOM.	85 992	3 095 712 €
PROSPERITY REAL	240 340	50 838 €
PROVIDENT FINANCI.	37 500	731 971 €
PRUDENTIAL	613 875	9 886 929 €
PRUDENTIAL FCIAL	113 659	7 606 962 €
PRYSMIAN	423 281	7 919 588 €
PS BUSINESS PARKS	8 042	446 019 €
PSP SWISS PROPERTY	17 514	1 078 994 €
PUBLIC SCE ENT.	29 575	687 701 €
PUBLIC STORAGE	86 164	9 412 443 €
PUBLICIS GROUPE	309 687	20 597 282 €
PULTE HOMES	14 945	220 937 €
PUMA R.RUDOLF ECH.	6 197	1 456 295 €
PURE INDUSTR RET	61 369	199 945 €
PVH	3 986	393 480 €
QANTAS AIRWAYS	246 908	175 538 €
QBE INS.GROUP	274 553	2 051 750 €
QEP RESOURCES	11 205	249 244 €
QIAGEN	546 977	9 263 056 €
QUALCOMM	320 329	17 261 360 €
QUANTA SERVICES	43 238	990 341 €
QUBE LOGISTICS HOL	119 847	161 072 €
QUEST DIAGNOSTICS	164 372	6 386 876 €
QUESTAR	15 761	262 969 €
QUINTAIN ESTATES	206 379	234 409 €
RACKSPACE HOSTING	12 486	354 581 €
RAFFLES MEDICAL GP	63 826	114 093 €
RAFLES EDUCATION NV	176 816	29 473 €
RAIFFEIS.INTL BK	39 543	1 013 092 €
RAKUTEN	678 900	7 331 351 €
RALPH LAUREN A	2 981	381 998 €
RAMCO GERSHENS.PB	26 430	301 915 €
RAMIRENT OYJ	244 000	2 232 600 €
RAMSAY HEALTH CARE	29 622	832 001 €
RANDGOLD RESOURCES	46 235	2 106 138 €
RANDSTAD PROV.DIV.	126 756	5 976 545 €
RANGE RESOURCES	11 502	703 776 €
RATIONAL	30 000	7 233 000 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
RAYONIER	5 749	175 653 €
REAL GOLD MINING LTD	90 500	- €
REALESTATE.COM.AU	12 086	296 304 €
REALTY INCOME	104 388	2 828 075 €
RECALL HOLDINGS LTD	71 270	187 869 €
RECKITT BENCKISER	155 271	8 944 879 €
RED ELECTRICA	113 962	5 527 157 €
RED HAT	10 470	425 821 €
REDEFINE INTL.	153 435	110 189 €
REED ELSEVIER	888 570	13 683 978 €
REGAL BELOIT	15 550	831 952 €
REGAL HOTELS INTL	108 337	49 178 €
REGENCY CENTERS	59 174	1 988 356 €
REGENERON PHARM.	6 077	1 213 900 €
REGIONS FINANCIAL	49 489	355 212 €
REGIS RESOURCES	83 258	157 845 €
REJECT SHOP LTD	5 835	65 578 €
RELIGARE HEALTH TR	127 675	56 873 €
REMY COINTREAU	34 061	2 077 380 €
RENAISSANCE RE HLD	28 217	1 993 354 €
RENAULT	239 423	13 994 274 €
RENISHAW PLC	464 316	10 854 503 €
REPROCELL INC	42 000	500 242 €
REPSOL DO14	139 856	69 369 €
REPSOL YPF	577 277	10 575 715 €
REPUBLIC SCES	122 913	2 961 544 €
RESONA HOLDINGS	530 700	1 964 063 €
RESTAURANT GROUP	350 000	2 490 385 €
RETAIL OPPORTUNITY	29 733	317 635 €
REX MINERALS	39 874	12 427 €
REXEL PROMESSES	445 235	8 492 858 €
REXLOT HOLDINGS	1 431 230	140 654 €
REYNOLDS AMERICAN	71 076	2 578 626 €
RICOH	50 000	385 970 €
RIETER HOLDING	37 690	6 461 582 €
RIGHTMOVE	302 300	9 955 553 €
RIO TINTO	99 805	4 418 066 €
RIO TINTO NOM.	235 457	9 648 926 €
RIOCAN REAL UNIT	177 939	3 010 518 €
RLJ LODGING TR SBI	54 086	954 620 €
RM	141 284	50 911 €
ROAD KING	66 446	46 145 €
ROBERT HALF INTL	7 814	238 123 €
ROC OIL COMPANY	138 719	44 132 €
ROCHE HOLDING BJ	82 191	16 713 176 €
ROCKWELL AUTOMAT.	5 327	456 810 €
ROCKWELL COLLINS	8 747	469 249 €
ROGERS CIONS CL.B	51 068	1 676 745 €
ROHTO PHARM.	110 000	1 219 015 €
ROLLS ROYCE HOL PRE	26 156 900	31 439 €
ROLLS ROYCE HOLDIN	200 850	3 077 930 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
ROPER INDUSTRIES	81 199	8 172 347 €
ROSS STORES	20 378	1 108 153 €
ROTORK PLC	188 400	6 498 894 €
ROUSE PROPERTIES	6 568	105 772 €
ROWAN CIES	7 025	180 277 €
ROYAL BANK CANADA	35 370	1 725 195 €
ROYAL CARIBBEAN	3 884	133 667 €
ROYAL DUTCH SHELL	577 907	15 024 193 €
ROYAL DUTCH SHELL	314 678	8 623 388 €
RPC GROUP	194 480	1 379 125 €
RPS GROUP PLC	1 000 000	4 034 856 €
RTL GROUP	20 193	1 896 728 €
RUBIS	46 172	2 125 528 €
RWE	334 710	8 904 960 €
RYANAIR HOLDINGS	1 910 930	11 971 976 €
RYDER SYSTEM	5 079	271 956 €
RYMAN HEALTHCARE G	94 548	443 317 €
RYOHIN KEIKAKU	19 100	1 499 461 €
S.E	41 338	91 254 €
S.R	562 000	34 664 €
S.S LTD	35 559	53 101 €
SA SA INTERNATIONAL	190 275	161 882 €
SABANA SHARIAH CO	147 137	91 337 €
SABMILLER	116 855	4 355 377 €
SABRA HEALTH CARE	16 679	316 416 €
SAFESTORE HOLDING	30 734	59 473 €
SAFEWAY	42 521	1 005 087 €
SAF-HOLLAND SA	144 711	1 563 602 €
SAFRAN	449 066	22 682 324 €
SAINSBURY	226 634	994 248 €
SAINT-GOBAIN	529 227	21 155 849 €
SAIPEM	237 968	3 702 782 €
SAIZERIYA	63 500	564 717 €
SALESFORCE.COM	29 787	1 193 080 €
SALVATORE FERRAGAM	208 940	5 777 191 €
SALZGITTER	87 030	2 697 930 €
SAMPO A	571 384	20 409 836 €
SAMSONITE INTL SA	292 995	647 182 €
SANDFIRE RESOURCES	34 513	144 757 €
SANDISK	10 719	548 747 €
SANDS CHINA	552 974	3 278 727 €
SANKEN ELECTRIC	124 000	663 537 €
SANOFI AVENTIS	1 709 248	131 817 206 €
SANTOS	219 077	2 080 961 €
SAP SYSTEME ORD.	727 886	45 354 577 €
SAPUTO	9 296	307 253 €
SARACEN MINERAL	120 532	14 478 €
SAUL CENTERS	5 741	198 866 €
SAWAI PHARM.	48 200	2 263 067 €
SBA COMMUNICATIONS	21 513	1 402 662 €
SBM OFFSHORE	157 504	2 331 059 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
SCAG	26 386	227 678 €
SCANA	18 074	615 584 €
SCANIA S.B	235 800	3 354 488 €
SCHEIN HENRY	9 984	827 906 €
SCHIBSTED	74 000	3 551 334 €
SCHINDLER HOLD.BP	15 122	1 620 170 €
SCHINDLER HOLD.NOM	40 370	4 335 122 €
SCHLUMBERGER ORD	87 033	5 691 664 €
SCHNEIDER ELECTRIC	760 015	48 184 951 €
SCHNITZER STL CL.A	9 200	218 132 €
SCHOELLER BLECKM.	125 571	10 116 000 €
SCHRODER REAL ESTATE	56 045	33 681 €
SCHRODERS	26 000	811 875 €
SCHWAB CHARLES	50 207	947 371 €
SCOR REGPT	465 119	12 355 886 €
SCOTT.SOUTH.ENERGY	537 018	8 842 724 €
SCRIPPS NETWORKS	6 986	438 102 €
SEAGATE TECHNOLOGIE	26 922	1 097 278 €
SEALED AIR	131 189	3 241 879 €
SEARS HOLDINGS	4 096	145 778 €
SEB	96 162	6 317 843 €
SEEK	77 419	674 061 €
SEGA SAMMY	16 600	306 830 €
SEGRO NV09	326 623	1 311 203 €
SEI INVESTMENTS	8 455	213 108 €
SEIKAGAKU	148 200	1 315 924 €
SEIKO EPSON	69 000	1 345 888 €
SEKISUI HOUSE	212 200	2 153 794 €
SELECT INCOME REIT	12 209	236 932 €
SEMBCORP IND.	204 364	644 878 €
SEMBCORP MARINE	190 897	488 270 €
SEMICOND.MFG INTL	4 849 837	276 892 €
SEMPRA ENERGY	10 779	702 172 €
SENEX ENERGY LTD	255 929	122 963 €
SENIOR	930 000	3 433 846 €
SENIOR HOUSING	82 609	1 332 751 €
SENSATA TECHNOLOGI	95 879	2 697 749 €
SEQUENOM INC	31 372	53 277 €
SES GLOBAL FDR	805 446	18 895 763 €
SEVEN AND I HOLD.	61 800	1 783 636 €
SEVEN GRP HOLDINGS	22 819	118 969 €
SEVEN WEST MEDIA	149 004	227 347 €
SEVERN TRENT	112 365	2 302 672 €
SG	48 117	121 214 €
SGS NOM.	5 507	9 221 023 €
SHAFTESBURY	1 362 702	10 269 401 €
SHANGRI LA ASIA	328 269	464 553 €
SHAW CIONS CL.B	78 303	1 382 557 €
SHERWIN-WILLIAMS	11 753	1 565 190 €
SHIMAO PROPERTY	611 233	1 019 456 €
SHIN MITSUI SUGAR	32 000	89 263 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
SHIN-ETSU CHEMICAL	169 000	7 164 676 €
SHINSEI BANK	949 000	1 683 995 €
SHIONOGI	36 800	579 327 €
SHIP HEALTHCARE HG	55 600	1 568 225 €
SHIRE	43 074	1 476 527 €
SHOPPERS DRUG MART	17 162	682 119 €
SHOPPING CENT AU	145 806	146 260 €
SHUI ON LAND	2 138 243	476 308 €
SHUN TAK HOLDINGS	409 491	174 768 €
SHW AG	16 919	786 141 €
SIA ENGINEERING	51 086	148 578 €
SIEMENS	446 142	44 297 439 €
SIG	244 972	623 030 €
SIGMA PHARMA.	264 895	111 792 €
SIGMA-ALDRICH	4 533	309 273 €
SIKA POR.	1 439	3 723 435 €
SILVER BASE GROUP	152 239	15 959 €
SILVER BAY REALTY	16 864	195 700 €
SILVER LAKE RESOUR	91 816	31 893 €
SILVER WHEATON	103 682	1 519 059 €
SIMCORP	212 000	6 067 048 €
SIMON PROPERTY GRP	147 724	16 313 001 €
SIMS	39 046	276 075 €
SINGAMAS CONTAINER	406 020	69 163 €
SINGAPORE AIRLINES	116 233	695 474 €
SINGAPORE AIRPORT	144 235	267 777 €
SINGAPORE EXCHANGE	189 012	788 727 €
SINGAPORE POST	325 820	248 139 €
SINGAPORE PRESS	364 822	863 931 €
SINGAPORE TELECOM.	1 676 044	3 525 877 €
SINO LAND	1 990 462	1 974 757 €
SINO OIL AND GAS H	2 368 888	55 429 €
SINOPOLY BATTERY L	1 872 845	61 351 €
SIRIUS RESOURCES	49 275	72 623 €
SIRIUS XM HOLDINGS	310 834	787 293 €
SIRTEX MEDICAL	10 859	82 701 €
SJM HLDGS LTD	418 979	1 019 576 €
SKY CITY ENTERT.	131 224	292 358 €
SKY NETWORK TV	88 257	307 861 €
SL GREEN REALTY	46 352	3 107 626 €
SLIGRO FOOD GROUP	220 313	6 215 030 €
SLM	32 438	618 674 €
SMARTONE TELECOM.	116 280	96 426 €
SMC	23 600	4 318 166 €
SMITH NEPHEW	219 692	2 273 495 €
SMITH(DS)	56 500	225 457 €
SMRT CORP.	159 071	106 060 €
SMS MT	14 740	38 185 €
SMUCKER	16 485	1 239 695 €
SNAM RETE GAS	4 944 310	20 103 564 €
SNC LAVALIN	11 245	367 063 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
SOCAM DEVELOPMENT	42 034	35 329 €
SOCIETE GENERALE A	980 987	41 417 271 €
SODEXHO ALLIANCE	217 740	16 034 374 €
SOFTBANK	266 850	16 951 046 €
SOFTWARE	55 728	1 415 491 €
SOHO CHINA LTD	684 404	427 901 €
SOL MELIA	275 000	2 567 125 €
SOLVAY	48 009	5 521 035 €
SO-NET M3	738	1 342 698 €
SONIC HEALTHCARE	87 195	938 640 €
SONY	289 600	3 651 244 €
SONY FIN.HOLD.	202 600	2 677 459 €
SORIN	459 815	953 656 €
SOUTHERN	161 967	4 832 327 €
SOUTHERN COPPER	12 302	256 325 €
SOUTHERN CROSS MED	112 956	123 942 €
SOUTHWEST AIRLINES	27 899	381 462 €
SOUTHWEST.ENERGY	29 852	852 079 €
SOVRAN SELF	13 873	656 146 €
SP AUSNET UNITS	380 490	307 564 €
SPARK INFRASTRUCT.	302 603	319 264 €
SPECTRA ENERGY	109 577	2 832 668 €
SPECTRIS	223 485	6 879 148 €
SPH REIT	131 747	74 211 €
SPIRAX-SARCO ENGIN	281 101	10 102 067 €
SPIRIT RLTY CAP	143 336	1 022 565 €
SPONDA	107 167	366 511 €
SPORTS DIRECT INTL	617 671	5 308 110 €
SPRINT NEXTEL CORP	44 901	350 305 €
SPX	9 455	683 513 €
ST BARBARA	107 260	18 106 €
ST JUDE MEDICAL	23 399	1 052 013 €
ST MODWEN PROP.	74 378	328 354 €
ST TELEMEDIA ORD	65 889	227 587 €
ST. JAMES S PLACE	1 741 194	15 235 448 €
STAG INDUSTRIAL	18 923	280 020 €
STAGECOACH GROUP NV	1 348 592	6 133 500 €
STANDARD CHARTERED	396 654	6 483 767 €
STANLEY BLACK DECKER	5 695	333 500 €
STAPLES	43 206	498 253 €
STARBUCKS	252 393	14 358 870 €
STARHILL GLOBALREIT	310 051	139 895 €
STARHUB	133 230	328 519 €
STARPHARMA HOLDING	55 227	31 016 €
STARWOOD HOTELS	7 026	405 121 €
STARZ - LIBERTY	15 323	325 165 €
STATE STREET	147 435	7 852 714 €
STATOILHYDRO	509 128	8 952 477 €
STEDIM	40 000	4 874 000 €
STELLA INTL HOLDINGS	56 170	103 883 €
STERICYCLE	47 256	3 984 128 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
STMICROELECTRONICS	1 056 070	6 167 449 €
STOCK SPIRIT GROUP	445 256	1 498 458 €
STOCKLAND	1 484 424	3 479 269 €
STORA ENSO S.R	439 969	3 209 574 €
STOREBRAND	925 828	4 197 285 €
STRABAG	35 946	766 369 €
STRATEC BIOMEDICAL	214 571	6 490 773 €
STRATEGIC HOTELS	74 305	509 603 €
STRYKER	8 256	450 218 €
STW CIONS GROUP	76 699	74 448 €
STX OSV HOLDINGS	133 909	62 729 €
SUDZUCKER	106 631	2 092 100 €
SUEZ ENVIRON.COMP.	443 661	5 778 685 €
SULZER	45 002	5 284 201 €
SUMITOMO REALTY	327 444	11 824 429 €
SUMITOMO ELECTRIC	130 000	1 574 398 €
SUMITOMO METAL	29 000	275 723 €
SUMITOMO MITSUI	547 400	20 485 452 €
SUMITOMO RUBBER	295 800	3 051 337 €
SUN ART RETAIL GRO	502 302	514 323 €
SUN COMMUNITIES	15 238	471 550 €
SUN HUNG KAI PROP.	1 005 076	9 251 820 €
SUN LIFE FINANCIAL	26 731	685 050 €
SUNCOR ENERGY	284 184	7 228 587 €
SUNCORP GROUP	295 167	2 510 510 €
SUNLAND GROUP	22 697	20 263 €
SUNLIGHT REIT	269 593	75 698 €
SUNSTONE HOTEL	71 973	699 933 €
SUNTEC REAL ESTATE	1 376 312	1 218 255 €
SUNTRUST BANKS	20 751	554 354 €
SUPER GROUP	48 397	105 707 €
SUZUKI MOTOR	125 900	2 458 366 €
SVENSKA CELLULOS.B	147 484	3 299 642 €
SWATCH GROUP POR.	9 903	4 763 622 €
SWIBER HOLDINGS	93 137	35 600 €
SWIRE PACIFIC CL.A	155 646	1 324 207 €
SWIRE PROPERTIES	782 409	1 435 304 €
SWISS PRIME SITE	127 576	7 188 187 €
SWISS RE	111 310	7 452 457 €
SWISSCOM NOM.	23 447	9 009 541 €
SWISSQUOTE GROUP	63 600	2 031 775 €
SYDNEY AIRPORT UNITS	272 709	672 831 €
SYMANTEC	140 986	2 412 693 €
SYMRISE	192 151	6 437 059 €
SYNERGY HEALTH	50 055	723 752 €
SYNGENTA NOM.	35 965	10 424 127 €
SYNOPSIS	83 092	2 446 507 €
SYSCO	18 690	489 665 €
SYSMEX	38 900	1 667 949 €
T AND D	605 700	6 143 570 €
TABCORP HOLDINGS	168 391	396 870 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
TADANO	148 000	1 440 862 €
TAG TEGERNSEE IMMO	155 480	1 365 114 €
TAIHEIYO CEMENT	675 000	1 882 897 €
TAISEI	657 000	2 168 377 €
TAKASHIMAYA	73 000	527 729 €
TAKEDA PHARMA.	38 100	1 269 298 €
TAKKT	710 990	9 591 255 €
TALANX AG	35 533	875 888 €
TALISMAN ENERGY	37 648	317 580 €
TANGER FACTORY OUT	41 340	960 670 €
TAP OIL	51 904	17 018 €
TARGET	69 054	3 170 801 €
TAT HONG	60 886	31 496 €
TATTS GROUP	318 211	640 471 €
TAUBMAN CENTERS	27 975	1 297 744 €
TAYLOR WIMPEY	4 093 000	5 485 210 €
TCC INTL HOLD.	222 176	79 020 €
TCL COMM TECH HLDG	107 000	79 316 €
TD AMERITRADE HLDG	34 270	762 053 €
TDC	607 545	4 283 590 €
TDK	130 900	4 555 244 €
TE CONNECTIVITY LTD	14 119	564 699 €
TECAN GROUP NOM.	72 334	6 227 040 €
TECHNIP	195 304	13 643 937 €
TECHNOPOLIS OYJ	28 693	124 815 €
TECHTRONIC INDUST.	287 859	592 729 €
TECK COMINCO CL.B	12 586	237 699 €
TECNICAS REUNIDAS	56 966	2 249 303 €
TECO ENERGY	11 712	146 538 €
TEL.ERICSSON S.B	290 700	2 578 525 €
TELECITY GROUP PLC	300 000	2 615 986 €
TELECOM ITAL.EPAR.	10 929 853	6 219 086 €
TELECOM ITAL.ORD.	16 085 195	11 597 426 €
TELECOM NEW ZEALD	415 992	572 728 €
TELEFONICA	2 169 804	25 679 630 €
TELEFONICA DEUTSCH	624 629	3 747 774 €
TELEKOM AUSTRIA	360 261	1 982 877 €
TELENET GROUP HOLD	147 819	6 411 649 €
TELENOR	495 310	8 567 307 €
TELIASONERA	1 002 453	6 065 690 €
TELLA INC	33 200	604 262 €
TELSTRA	1 004 305	3 423 322 €
TELUS CORP	108 610	2 712 190 €
TEMP HLDGS	180 200	3 480 076 €
TEN NETWORK HOLD.	383 228	69 669 €
TENARIS	347 978	5 525 891 €
TERADATA	12 163	401 549 €
TERADYNE	294 119	3 761 069 €
TERNA	3 077 247	11 176 561 €
TERUMO	108 100	3 784 209 €
TESCO	434 847	1 747 489 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
TEXAS INSTRUMENTS	106 276	3 386 733 €
TEXWINCA HOLD.DIV.	142 001	108 451 €
TF1	183 932	2 576 887 €
TGS-NOPEC GEOPHYS.	653 298	12 565 978 €
THALES	199 741	9 347 879 €
THE LINK REIT	1 486 781	5 232 253 €
THE MOSAIC	18 233	625 498 €
THERMO FISHER	40 444	3 268 335 €
THOMSON REUTERS	24 705	677 846 €
THORN GROUP LIMITE	32 733	46 118 €
THYSSENKRUPP	322 904	5 712 172 €
TIBCO SOFTWARE	158 370	2 583 756 €
TIFFANY	7 455	501 978 €
TIGER AIRWAYS HLDG	101 721	29 818 €
TIGER RESOURCES	177 449	39 748 €
TIM HORTONS	43 992	1 862 685 €
TIME WARNER	254 177	12 861 035 €
TIME WARNER CABLE-WI	47 289	4 650 308 €
TINGYI HOLDING	435 158	912 324 €
TITAN PETROCHEMICALS	780 000	- €
TJX COS	73 531	3 400 922 €
T-MOBILE US	38 392	937 301 €
TNT EXPRESS NV	517 820	3 494 249 €
TOD S GROUP	31 500	3 824 100 €
TOEI	399 000	1 639 198 €
TOHOKU ELEC.POWER	30 000	245 046 €
TOKAI TOKYO SECU.	117 400	823 575 €
TOKIO MARINE HOLD.	280 800	6 814 969 €
TOKYO ELECTRON	4 400	174 991 €
TOKYO GAS	148 000	529 338 €
TOKYO STEEL MFG	150 000	564 455 €
TOKYO TATEMONO	487 082	3 928 135 €
TOKYU	158 000	742 926 €
TOKYU FUDOSAN HOLD	153 900	1 051 999 €
TOKYU REIT	72	322 640 €
TOLL BROTHERS	19 552	525 019 €
TOLL HOLDINGS	155 505	573 476 €
TOM TAILOR HOLDING	384 594	6 345 801 €
TOMRA SYSTEMS	228 300	1 542 955 €
TOMY	98 000	317 351 €
TOP REIT	82	279 693 €
TOPCON	125 200	1 379 681 €
TOPDANMARK	190 000	3 636 851 €
TOPPAN FORMS	69 900	465 743 €
TORAY INDUSTRIES	1 003 000	5 041 663 €
TORCHMARK	4 342	246 264 €
TORONTO DOMIN BANK	30 276	2 070 237 €
TOSHIBA	840 000	2 563 557 €
TOSHIBA MACHINE	85 000	356 832 €
TOSHIBA TEC	80 000	402 679 €
TOSOH	86 000	290 368 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
TOTAL FINA	2 597 037	115 646 058 €
TOTAL SYSTEM SERV.	74 212	1 792 420 €
TOUR EIFFEL	1 700	82 569 €
TOWER	29 576	30 915 €
TOWNGAS CHINA	152 535	128 346 €
TOX FREE SOLUTIONS	26 895	60 942 €
TOYOTA MOTOR	642 600	28 485 065 €
TPV TECHNOLOGY	184 528	27 634 €
TRACTOR SUPPLY	10 364	583 525 €
TRADE ME GROUP LTD	90 758	220 092 €
TRANSALTA	26 906	247 733 €
TRANSCANADA	105 021	3 481 930 €
TRANSDIGM GROUP INC	3 294	384 934 €
TRANSFIELD SCES	115 175	66 927 €
TRANSPACIFIC IND.	237 170	180 164 €
TRANSURBAN UNIT	334 562	1 485 784 €
TRAVELERS COS.	206 440	13 564 901 €
TREASURY WINE EST	147 195	460 641 €
TRELLEBORG S.B	192 000	2 774 780 €
TRIMBLE NAVIGATION	28 308	712 887 €
TRINITY	215 636	52 475 €
TRIPADVISOR	5 860	352 263 €
TROY RESOURCES	37 459	19 092 €
TRULY INTL HLDGS	248 825	97 114 €
TRW AUTOMOTIVE	6 092	328 895 €
TRYGVESTA	223 426	15 708 073 €
TUI NOM.	128 410	1 537 710 €
TURQOISE HILL DS	8 681	5 929 €
TURQOISE HILL	21 440	51 402 €
TV BROADCASTS	66 971	325 005 €
TWENTY FST CENTUR B	28 678	720 124 €
TYCO INTL	108 176	3 221 963 €
TYSON FOODS CL.A	343 006	8 329 328 €
U S BANCORP	101 941	2 988 908 €
U STORE IT TRUST	58 823	680 484 €
UBE INDUSTRIES	402 000	624 525 €
UBI BANCA	1 342 381	6 625 993 €
UBS NOM.	474 642	6 553 197 €
UCB	192 155	10 403 272 €
UDR	109 799	1 860 662 €
UK COMMERCIAL	70 889	65 606 €
ULTA SALON COS&FRA	78 570	5 503 720 €
ULTRA ELECTRONICS	244 362	5 662 619 €
ULTRA PETROLEUM	15 884	249 574 €
UMICORE	295 330	10 027 930 €
UNIBAIL	107 909	20 098 051 €
UNICREDIT	2 519 327	13 553 979 €
UNILEVER	341 172	10 177 751 €
UNILEVER	1 420 465	41 584 113 €
UNION PACIFIC ORD.	109 130	13 305 639 €
UNI-PRESIDENT CHINA	242 691	179 446 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
UNIT 4 AGRASSO	394 355	15 125 486 €
UNITE GROUP	75 524	365 456 €
UNITED COMPANY RUS	375 607	80 857 €
UNITED CONTINENTAL	7 527	206 652 €
UNITED ENGINEERS	104 226	107 533 €
UNITED GROUP	38 263	181 601 €
UNITED LABORATORIE	109 691	31 929 €
UNITED OVS BK LCL	267 980	3 271 580 €
UNITED PARCEL CL.B	73 934	5 638 279 €
UNITED TECHNO.	27 038	2 233 053 €
UNITED UTILITIES	546 809	4 413 248 €
UNITEDHEALTH GROUP	208 265	11 381 344 €
UNIV.HEAL.SCE CL.B	14 507	855 533 €
UNIVERSAL HEALTH	5 745	167 026 €
UNUM GROUP	11 182	284 683 €
UOB-KAY HIAN HOLD.	57 290	54 498 €
UOL GROUP	297 997	1 060 238 €
UPM KYMMENE	360 226	4 423 575 €
URBAN OUTFITTERS I	22 290	600 159 €
URSTADT BIDDLE A	3 510	46 999 €
UTD INTERNET NOM.	182 147	5 631 985 €
UTD STATES STEEL	8 377	179 346 €
UTD URB.INV.REIT	927	968 412 €
UXC	65 290	42 391 €
VACON OYJ	142 000	8 307 000 €
VALEANT PHARM INTL	10 593	901 677 €
VALEO	248 117	19 956 050 €
VALERO ENERGY	117 216	4 287 457 €
VALLOUREC	178 921	7 085 272 €
VALMET OY	104 466	- €
VALUE PARTNERS GRP	172 061	96 625 €
VARIAN MEDICAL SYS	7 810	440 350 €
VARITRONIX INTL	56 862	44 120 €
VASTNED RETAIL	7 732	255 040 €
VECTOR LIMITED	56 164	86 215 €
VENTAS	148 450	6 171 142 €
VENTURE CORP.	56 932	251 315 €
VEOLIA ENVIRON.	568 636	6 741 180 €
VERBUND	130 659	2 027 174 €
VERISIGN	30 374	1 317 772 €
VERISK ANALYTICS A	78 966	3 766 344 €
VERIZON CIONS	179 225	6 391 695 €
VERTEX PHARM.	13 941	751 735 €
VETROPACK HOLDINGS	950	1 411 628 €
VF	17 120	774 556 €
VIACOM CL.B	11 959	758 037 €
VICTREX PLC	600 952	13 268 616 €
VIENNA INSUR.GROUP	79 918	2 895 030 €
VINCI	700 728	33 438 740 €
VIRBAC	68 190	10 589 907 €
VIRGIN HOLDINGS	305 335	75 333 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
VIRGIN HOLDINGS NV	441 960	- €
VIRTUS HEALTH LTD	13 657	77 498 €
VISA INC LTD	113 652	18 367 100 €
VISCOFAN	176 077	7 280 784 €
VITAL HEALTHCARE	62 498	47 782 €
VITASOY INTL HDGS	176 136	196 837 €
VIVENDI UNIVERSAL	1 760 398	33 720 424 €
VMWARE A	5 458	355 350 €
VODAFONE GROUP	7 661 186	21 823 330 €
VOESTALPINE	88 105	3 077 508 €
VOLKSWAGEN ORD.	47 829	9 417 530 €
VOLKSWAGEN PF	140 059	28 593 045 €
VORNADO REALTY	78 453	5 055 405 €
VTECH HOLDINGS	36 833	347 153 €
VULCAN MATERIALS	7 313	315 363 €
W P CAREY	25 474	1 134 211 €
W.A NL	38 490	59 227 €
WACKER CHEMIE	13 412	1 078 057 €
WAL MART STORES	127 465	7 279 353 €
WALGREEN	44 142	1 840 131 €
WALLENSTAM	276 523	3 038 628 €
WANT WANT CHINA	1 510 061	1 582 947 €
WAREHOUS.DISTRIB.	3 918	206 479 €
WAREHOUSE GROUP	25 150	56 183 €
WARTSILA	130 100	4 653 677 €
WASH.REAL ESTATE	29 162	494 393 €
WASTE CONNECTIONS	141 610	4 483 957 €
WASTE MANAGEMENT	96 392	3 138 914 €
WATERS	3 387	245 809 €
WATPAC	33 000	20 676 €
WEATHERFORD	47 522	534 230 €
WEBJET	14 276	29 383 €
WEIGHT WATCHERS	6 053	144 659 €
WEINGARTEN RTY IN	63 017	1 254 029 €
WEIR GROUP	94 471	2 420 819 €
WELLPOINT INC	15 486	1 038 357 €
WELLS FARGO	813 509	26 804 056 €
WENDEL INVEST.	46 212	4 896 161 €
WERELDHAVE	11 299	645 964 €
WERELDHAVE BELGIUM	1 066	88 713 €
WESFARMERS	260 758	7 456 033 €
WESTERN DIGITAL	129 889	7 908 910 €
WESTERN UNION	47 917	599 875 €
WESTF.GRP ST.UNITS	1 371 613	8 985 570 €
WESTFIELD	2 050 893	3 954 780 €
WESTPAC BANKING	705 432	14 830 469 €
WEYERHAEUSER	17 422	399 167 €
WHARF HOLDINGS	1 009 928	5 605 302 €
WHEELOCK	186 570	622 523 €
WHIRLPOOL	4 625	526 510 €
WHITBREAD	23 000	1 036 935 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
WHITE MOUNTAINS	1 228	537 472 €
WHITEHAVEN COAL LTD	134 759	167 114 €
WHK GROUP LIMITED	46 980	10 523 €
WHOLE FOODS MARKET	179 190	7 520 544 €
WIENERBERGER	208 000	2 397 200 €
WIHLBORGS FASTIGH.	66 930	580 816 €
WIHLBORGS SYD	29 527	384 518 €
WILH.WILHELMOSEN	98 465	668 416 €
WILLIAM DEMANT	64 767	4 575 179 €
WILLIAMS COMPANIES	21 083	590 153 €
WILLIS GROUP HDG LLC	37 675	1 225 210 €
WILMAR INTL	481 907	947 305 €
WINDSTREAM HLDG INC	37 730	218 510 €
WING HANG BANK	39 695	434 686 €
WING TAI HOLDINGS	288 323	325 644 €
WINTHROP REALTY	9 016	72 303 €
WIRECARD	270 700	7 773 151 €
WISCONSIN ENERGY	99 101	2 973 246 €
WM.MORRIS.SUPERM.	1 127 111	3 535 769 €
WOLTERS KLUWER	204 652	4 245 506 €
WOODSIDE PETROLEUM	141 529	3 574 522 €
WOOLWORTHS	281 003	6 175 790 €
WORKSPACE GROUP REIT	24 788	157 308 €
WORLD DUTY FREE SA	240 100	2 194 514 €
WORLEYPARSONS	49 239	530 689 €
WOTIF.COM HLDGS	30 461	54 783 €
WPP PLC	165 600	2 746 731 €
WPX ENERGY	10 368	153 349 €
WS ATKINS	404 443	6 893 031 €
WYNDHAM WORLDWIDE	16 771	896 912 €
WYNN MACAU LTD	237 625	781 756 €
WYNN RESORTS	6 599	930 105 €
XCEL ENERGY	114 579	2 323 345 €
XEROX ORD.	44 214	390 510 €
XILINX	16 019	533 850 €
XINCHEN CHINA POWE	178 240	86 749 €
XINYI GLASS HLDGS	431 569	276 287 €
XINYI SOLAR HLDG	390 552	58 486 €
XL GROUP	19 397	448 219 €
XYLEM	9 284	233 128 €
YAHOO	99 336	2 915 413 €
YAHOO JAPAN	504 800	2 038 997 €
YAMANA GOLD	354 014	2 214 930 €
YAMATO KOGYO	139 700	3 240 986 €
YANCHANG PRETRO INTL	915 352	38 124 €
YANGZIJ.SHIPBUILD.	473 410	322 446 €
YANLORD LAND GROUP	448 627	315 880 €
YASKAWA ELECTRIC	134 000	1 538 645 €
YGM TRADING	21 658	35 474 €
YING LI INTL REAL	192 620	43 732 €
YINGDE GASES GROUP	203 311	154 515 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
YIP'S CHEMICAL	54 247	33 967 €
YOMA STRATEGIC	150 835	65 023 €
YOOX	215 996	7 041 470 €
YUE YUEN IND.	190 449	461 671 €
YUM BRANDS	28 828	1 581 889 €
ZARDOYA OTIS	154 351	2 029 716 €
ZEON	83 000	564 489 €
ZIGGO NV	255 568	8 484 858 €
ZIMMER HOLDINGS	9 762	660 223 €
ZIONS BANCORP.	12 752	277 270 €
ZODIAC	102 537	13 201 639 €
ZUMTOBEL	260 000	2 951 000 €
ZURICH FINANC.SCES	62 859	13 259 120 €

BONDS

TOTAL (€)	19 138 061 007 €
------------------	-------------------------

Security name	Quantity	Stock price (€)
3I GROUP 5.625 17	4 500	5 147 470 €
A2A SPA 4.50%1116	2 000	2 168 347 €
ABB FINANCE 2.625%19	4 600 000	4 865 091 €
ABBEY NATL 2.625%20	9 803 000	9 971 354 €
ABBEY NATL 3.05% 18	4 920 000	3 701 401 €
ABBEY SVC 1.75% 2018	1 410 000	1 435 942 €
ABBEY SVC 3.375% 15	4 398	4 618 702 €
ABBVIE 1.75% 2017	8 306 000	6 040 954 €
ABBVIE INC 2.9% 2022	10 735 000	7 305 731 €
ABERTIS 4,75%14	20	2 093 790 €
ABERTIS 4.625% 1016	12	656 624 €
ABERTIS 4.75% 19	2 200 000	2 461 976 €
ABERTIS 5,125%0617	16	913 308 €
ABN 6.375% 2021	6 585	7 900 242 €
ABN AMR BK 7.125%22	3 780 000	4 671 127 €
ABN AMRO BK 1.375%16	2 090 000	1 533 719 €
ABN AMRO BK 2.5% 23	4 700 000	4 516 008 €
ABN AMRO BK 4.25%17	11 300 000	8 949 303 €
ABNAMRO NV 4.125% 22	2 300 000	2 612 400 €
ABNAMRO NV 4.25% 16	290	320 322 €
ACCOR 2.5%210319	4 500 000	4 593 877 €
ACCOR 2.875% 06/17	4 200 000	4 410 975 €
ACE INA 6.7% 05/36	4 000	3 655 277 €
ACEA 4.50%10-2020	2 000	2 244 186 €
ACESM 4.375% 2020	9	1 005 949 €
ACHMEA BV 2.5% 20	12 000 000	11 929 172 €
ACHMEA BV 6% 43	5 466 000	6 141 675 €
ACUITY BANDS 6% 19	1 600	1 277 236 €
ADECCO .4.75% 2018	4 300	4 901 169 €
ADECCO 2.75% 2019	3 400 000	3 409 071 €
ADOBE SYS 3.25% 15	3 515	2 654 587 €
ADOBE SYS 4.75%10-20	6 400	5 112 946 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
AEGON NV 3% 07/17	13 361 000	14 297 031 €
AEROPORTI 3.25% 21	5 657 000	5 712 575 €
AETNA 1.75% 05/17	550 000	398 723 €
AETNA 4.5% 15/05/42	670 000	452 567 €
AETNA INC 2.75%22	900 000	602 904 €
AFLAC 3.625% 13-2023	8 075 000	5 647 546 €
AG.FSE DEV.TV PERP	954 000	983 265 €
AGF 4,625%05-PERP.	2 235 000	2 338 010 €
AGILENT TECH INC	2 500	1 984 090 €
AGRIUM 3.5% 23	975 000	659 286 €
AGRIUM 4.9% 43	1 075 000	716 912 €
AGRIUM 3.15% 22	1 055 000	705 816 €
AGRIUM IN 7.125 36	2 450	2 108 416 €
AGRIUM INC 6.75% 19	3 000	2 629 703 €
AIB MTG BK 4.875%17	750 000	837 533 €
AIB MTGE BK 2.625%16	730 000	755 316 €
AIG 6.797% 2017	1 144 000	1 355 152 €
AIG 5% 26/06/17	6 900 000	7 870 660 €
AIG 5.6% 18/10/16	5 330 000	4 354 103 €
AIG 6.40 15/12/20	1 722	1 478 982 €
AIG SU X 6.90% 2032	2 500 000	2 330 349 €
AIR LIQ FI 2.375% 23	3 200 000	3 140 059 €
AIR LIQU 2.125% 21	1 900 000	1 876 919 €
AIR PROD & CHEM 2%20	6 400 000	6 367 544 €
AIRGAS 2.375% 2020	1 540 000	1 067 608 €
AIRLINES 4.95% 2023	1 225	934 775 €
ALCAN INC 7.25 31	339	304 909 €
ALD INTERNATION 2%17	7 400 000	7 375 185 €
ALEXANDRIA 3.9%2023	2 255 000	1 526 090 €
ALLD WA HL 7.5 16	2 365	2 022 190 €
ALLERGAN 5.75% 16	1 485	1 209 957 €
ALLGHNY ENGY 5.75%19	2 550 000	1 953 071 €
ALLIANDER 3.25% 2049	9 027 000	9 191 306 €
ALLIANZ 5.75% 2041	111	12 736 487 €
ALLIANZ II TV25 SR	5 000	5 582 567 €
ALLIANZ SE 4.75%2049	14 900 000	15 394 235 €
ALLIANZ TV 05-49	1 000	1 079 086 €
ALLIANZ TV04-PERP.	1 948	2 054 953 €
ALLIANZFIN 4.75%0719	60	3 509 649 €
ALLSTATE 3.15% 23	3 170 000	2 180 436 €
ALLTEL 7.875 07/32	928	864 149 €
ALTADIS EMIS.4%15	1 000	1 058 059 €
ALTRIA 10.2% 39	2 240	2 578 544 €
ALTRIA GROUP 4% 24	10 613 000	7 573 313 €
ALTRIA GROUP INC	4 640	3 644 882 €
ALTRIA GRP 4.125% 15	1 700	1 317 321 €
ALTRIA GRP 9.25% 19	3 598	3 528 650 €
AM BK FSB 6%07-2017	6 995 000	5 924 572 €
AM.MOVIL 5,50%14	4 600	3 423 066 €
AMADEUS CAP 4.875%16	7 628 000	8 461 842 €
AMCOR 2.75% 23	500 000	489 845 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
AMCOR 4.625% 04/19	4 000	4 585 515 €
AMER 5.04999 09/20	1 500	1 177 514 €
AMER CAMPUS 3.75% 23	3 845 000	2 607 500 €
AMER IGP 8.175% 58	1 635	1 427 372 €
AMER INTL 3.8%2017	1 000 000	781 572 €
AMER INTL 4.875% 16	1 625 000	1 310 722 €
AMER INTL 4.875%2022	6 500 000	5 058 478 €
AMER INTL 5.45%07-17	10 500	8 561 677 €
AMER MOVIL 3.75%17	2 823	3 107 067 €
AMER MOVIL 4.75%22	2 000	2 316 473 €
AMER TOWER 3,4% 2019	5 005 000	3 771 744 €
AMER TOWER 4.50 18	2 431	1 931 489 €
AMER TOWER 4.625% 15	291	223 101 €
AMERADE 7,125%03-33	4 000	3 553 694 €
AMERIC TOWER 3.07%23	4 050 000	2 727 338 €
AMERICA MO 5.125% 73	19 382 000	20 528 060 €
AMERICA MOV 2.375%16	1 660	1 246 795 €
AMERICA MOV 3.125%22	10 250 000	6 975 467 €
AMERICA MOV 4.125%19	13 463	14 926 159 €
america movil 3 0721	7 300	7 523 527 €
AMERICAN 4 3/8%16	192	10 553 425 €
AMERICAN 7%18 SR	6 200	5 463 485 €
AMERICAN INTERNTL GR	3 920	3 334 788 €
AMERIPRIS 7.518 66	2 000	1 617 576 €
AMGEN 2.125% 19	8 830 000	8 904 130 €
AMGEN 4.375%11-2018	9 070	10 189 108 €
AMGEN 5.65% 2042	1 014	777 044 €
AMGEN 5.75%0340 SR	2 090 000	1 640 404 €
AMGEN 6.4% 01/02/39	1 090	928 193 €
AMGEN INC 3.875% 21	2 000 000	1 488 627 €
AMGEN INC 4.5% 20	3 830	3 038 720 €
AMGEN INC 5.15% 1141	3 000	2 165 721 €
AMGEN INC 6.375% 37	430 000	358 086 €
AMT 5.9% 2021	1 765	1 401 192 €
ANADARKO 6.2% 40	1 700	1 366 337 €
ANADARKO 6.375 17	3 200	2 701 192 €
ANADARKO 6.45%06-36	1 742	1 433 648 €
ANGLIAN 6,25%16	1 352	1 571 914 €
ANGLO AME 2.75% 19	4 000 000	4 066 632 €
ANGLO AMER 2.625% 17	1 820 000	1 331 640 €
ANGLO AMER 4.125% 22	2 500 000	1 723 572 €
ANGLO ICAP 7.5 14	2 000	2 122 455 €
ANHEUS 2.5% 07/22	4 650 000	3 151 447 €
ANHEUS 3.75% 07/42	1 950 000	1 217 979 €
ANHEUS 5.37% 11/14	1 700 000	1 293 827 €
ANHEUS 5.375 20	2 800	2 375 217 €
ANHEUSER 2%12-2019	3 500 000	3 514 667 €
ANHEUSER- 2.25% 20	2 180 000	2 202 652 €
ANHEUSER 2.875%2024	3 500 000	3 509 531 €
ANHEUSER 7.75%2019	7 800	7 252 842 €
ANHEUSER BU 4% 06/21	648	734 178 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
AOL TIME 7 5/8%31	600	553 158 €
AON 3.50%300915	2 025	1 547 097 €
AON 4%13-2023	2 250 000	1 608 172 €
APACHE 3.625%10-2021	4 750	3 585 227 €
APACHE CORP 3.25% 22	489 000	349 864 €
APACHE CORP 4.25% 44	5 000 000	3 288 836 €
APACHE CORP 4.75% 42	1 500 000	1 056 529 €
APETRA 3.125%2023	1 400 000	1 443 720 €
APPLE 1% 13-2023	2 000 000	1 403 237 €
APPLE 2.40%13-2023	7 260 000	4 731 356 €
APPLIE MAT 5.85% 41	2 500	1 846 038 €
AQUARIUS 4.25%2043	11 600 000	11 706 002 €
AREVA 4.875% 0924	2 600 000	2 893 082 €
AREVA SA 3.25% 20	2 800 000	2 886 047 €
ASF 7.375%09-2019	5 000 000	6 603 350 €
ASSI GEN 5.125% 0924	10 500	11 567 283 €
ASSICU GEN 7.75%42	2 800 000	3 230 271 €
ASSO NTH 6.95%2018	4 254 000	3 708 499 €
ASSOC BANC-5.125%16	3 655	2 867 212 €
ASSURANT INC 4% 2023	3 005 000	2 107 695 €
AT AND T 5,50%18	4 905	4 098 466 €
AT AND T 6,125%15	26	1 447 613 €
AT& T INC 2.50%2023	7 000 000	6 910 816 €
AT& T INC 2.95% 2016	1 700 000	1 289 008 €
AT& T INC 3.50% 25	2 450 000	2 483 879 €
AT& T INC 6.5 37	1 261	1 041 690 €
AT&T INC 1.875%20	5 000 000	4 860 926 €
AT&T INC 2.65% 21	6 340 000	6 409 109 €
AT&T INC 3.55% 32	7 500 000	7 182 714 €
AT&T INC 4.3% 42	3 520 000	2 168 938 €
AT&T INC 4.35% 45	7 174 000	4 401 488 €
ATLANTIA 2.875%2021	7 376 000	7 419 407 €
ATLANTIA 3.375% 17	1 000 000	1 065 811 €
ATLANTIA 3.625%2018	4 500 000	4 753 101 €
ATLANTIA 4.375% 20	3 950 000	4 468 593 €
ATLANTIA 5.625%09-16	3 000	3 404 721 €
ATLAS COPCO 2.5%2023	1 340 000	1 352 247 €
ATR DU SUD 2.875%23	2 800 000	2 876 705 €
ATRIUM EUR 4%2020	2 700 000	2 767 182 €
AUSTRAL PAC 3.125%23	3 502 000	3 583 712 €
AUSTRAL PROP UNI	3 000	2 333 188 €
AUTODESK 1.95%2017	1 300 000	935 679 €
AUTOZONE 2.875% 23	4 540 000	2 995 221 €
AUTOZONE 6.5%08-2014	1 500	1 123 705 €
AVALONBAY 4.20% 2018	3 200 000	2 300 877 €
AVIVA 4.7291%2014	9 476 000	9 569 462 €
AVIVA 6.125%13-2043	6 676 000	7 602 926 €
AVIVA 6.875%22/05/38	1 000 000	1 179 304 €
AVIVA TVPERP.	304	3 206 410 €
AVNET 4.875% 22	10 125 000	7 383 186 €
AXA 1.564% 10/49	1 286 000	984 337 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
AXA 5,777%06-PERP.	2 500	2 673 581 €
AXA 5.125%13-2043	5 600 000	6 018 692 €
AXA 6,211%07-2017	2 900	3 141 875 €
AXA 8.6 15/12/30	200	178 653 €
AXA SA 5.25%04-40	90	4 976 219 €
AXIS FINANC 5.875%20	1 530	1 222 869 €
BAA 4.6%20 EMTN	10 900	12 567 470 €
BAA FUNDIN 4.12 16	510	554 002 €
BAA FUNDING 4.375%17	5 205 000	5 871 930 €
BAA FUNDING 4.6%16	1 100	1 143 803 €
BANCO BILBAO 3.5%17	3 600 000	3 853 795 €
BANK 4,5/8%17 MTN	40	2 229 570 €
BANK AMER 5.3 17	380	307 412 €
BANK AMER.5,75%17	2 246	9 291 505 €
BANK AMERICA 5.65%18	940	3 901 356 €
BANK NOV SCOT1.95%17	2 750 000	2 063 049 €
BANK OF AMER 2.6% 19	5 955 000	4 357 079 €
BANK OF AMER 3.3%30	19 595 000	13 579 576 €
BANK OF AMER 4.10%23	8 681 000	6 402 758 €
BANK OF AMER 5.7%22	3 455 000	2 890 174 €
BANK OF AMERICA 7%16	16	942 420 €
BARCL LOND 4.125%16	2 000	2 203 170 €
BARCL LOND 6% 2021	8 571	10 209 646 €
BARCLAYS 6.75% 0519	2 500	2 184 084 €
BARCLAYS 4.875%08-19	4 500	5 296 095 €
BARCLAYS 6%18 EMTN	2 250	2 663 990 €
BARCLAYS 6,05%1217	7 430	6 074 966 €
BARCLAYS BK 5.14%20	2 180	1 699 697 €
BARCLAYS BK 6.625%22	2 200	2 703 987 €
BARCLAYS BK TV19	1 000	1 040 503 €
BARRICK GOLD 4.10%23	9 710 000	6 410 917 €
BARRICK NO 4.40% 21	3 015 000	2 120 587 €
BAT HLDNV 4 07/20	3 800	4 278 894 €
BAT INTL 5 3/8%17	900	1 067 307 €
BAT INTL 5,875%15	1 655	1 834 564 €
BAT INTL FIN.2.75%25	1 000 000	991 513 €
BATSLN 4.0875%02-21	3 753	4 508 837 €
BAYER 5% 05-15	900 000	955 912 €
BAYER.HYPO.6%14	3 050	3 229 610 €
BB AND T 5.2% 2015	5 070	3 979 495 €
BB&T 1.6% 15/08/17	8 050 000	5 824 269 €
BBVA 4.25% 03/15	59	3 161 473 €
BBVA US 4.664% 2015	7 895 000	6 084 355 €
BBVAS 4.875% 2016	9	999 178 €
BCO BILB.V.3,25%16	30	3 213 892 €
BCO BILBAO 3.875%23	4 000 000	4 429 248 €
BELFIUS BK 2.25% 18	8 400 000	8 494 060 €
BEMIS CO 6.8% 0819	3 570	3 105 420 €
BERKSH HATH 4.4%42	2 610 000	1 721 292 €
BERTELSMANN 2.625%22	4 000 000	3 991 804 €
BFCM 1.625% 2018	6 300 000	6 394 736 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
BFCM 1.695% 2014	17 940 000	12 326 395 €
BFCM 2.5% 18	6 000 000	4 324 288 €
BFCM 2.625% 21	15 700 000	16 033 913 €
BFCM 3% 13-2023	3 900 000	3 946 821 €
BFCM 4% 22/10/20	2 000 000	2 131 258 €
BFCM 4.75% 2049	7 595	7 811 872 €
BG ENERGY 3.625%19	1 095	1 206 176 €
BG ENERGY 6.5% 11/72	6 000 000	6 780 414 €
BHARTI AIR 4% 18	6 000 000	6 038 453 €
BHP BILLITON 3.25%27	1 000 000	1 015 360 €
BHP FIN 2.125% 2018	4 120 000	4 218 024 €
BHP FINANCE 3.85%23	11 122 000	8 165 066 €
BHP FINANCE 5%2043	2 355 000	1 762 487 €
BK AME.4%18 EMTN	99	4 757 200 €
BK AMERICA 5.875%42	2 900 000	2 434 695 €
BK CANADA 2.625% 15	2 215	1 668 622 €
BK IRELAND 3.625%20	1 470 000	1 546 211 €
BK IRELAND 1.875%17	2 160 000	2 169 081 €
BK IRELAND 3.125%15	1 740 000	1 803 952 €
BK MONTREAL 1.95% 17	2 455 000	1 841 651 €
BKAMERICA 2.50% 2020	12 184 000	12 360 563 €
BKAMERICA 4.5 15	158	605 463 €
BKAMERICA 4.625% 17	362	20 337 165 €
BKAMERICA 5.625% 16	992	4 048 138 €
BKAMERICA 6.5% 16	1 377	5 769 510 €
BKAMERICA 7.375 14	2 253	8 455 069 €
BKAMERICA 7.625 19	860	3 880 964 €
BLACK 4.25% 11/23	8 179 000	5 946 283 €
BLACKST HLD 5.875%21	7 000	5 766 298 €
BLOCK 5,125%14	3 000	2 268 726 €
BMW US CAP 1% 2017	7 970 000	7 971 214 €
BNP 1.5% 03/2018	1 377 000	1 393 573 €
BNP 2.875% 2017	11 025 000	11 665 670 €
BNP 3.25%10-2015	1 870	1 411 168 €
BNP PARI 2.375% 17	5 805 000	4 320 189 €
BNP PARI 2.5% 08/19	15 515 000	16 111 320 €
BNP PARIB 3.5 %16	1 974 000	2 138 941 €
BNP PARIB 5.2% 17	1 800 000	1 979 760 €
BNP PARIBAS	347 000	355 820 €
BNP PARIBAS 2% 2019	8 000 000	8 131 421 €
BNP PARIBAS 2.40% 18	8 500 000	6 155 051 €
BNP PARIBAS 3.25%23	7 900 000	5 477 449 €
BNP PARIBAS TV08-18	60	3 605 092 €
BNP TV311249 PERP.	1 950 000	2 085 836 €
BNPP 4,875%PERP	5 000	4 877 592 €
BNZ INTL 1.25% 18	4 900 000	4 853 539 €
BNZ INTL 4 03/17	1 800	2 009 187 €
BOA 1.875% 19	16 329 000	16 232 773 €
BOA 4.75%03/04/2017	235	13 368 775 €
BOA 5.625% 2020	6 410	26 445 059 €
BOARDW PIP 3.375 23	3 500 000	2 315 988 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
BOEING 4.875% 02/20	4 600	3 777 127 €
BOEING 5.875 %40	225	195 955 €
BORD GAIS 3.62% 17	880 000	934 593 €
BOSTON 4.125% 2023	1 635 000	1 191 080 €
BOSTON PP 3.85% 23	4 090 000	2 939 630 €
BOSTON PRO 3.125% 23	1 030 000	689 141 €
BOSTON PRO 3.8% 24	2 225 000	1 570 095 €
BOSTON PROP 3.7% 18	1 100	845 913 €
BOSTON SCIEN.2.65%18	1 635 000	1 205 961 €
BOUYGUES 3.641% 2019	400 000	433 505 €
BOUYGUES 4% 02/2018	4 000 000	4 512 141 €
BP 3.561ù 2021	5 800	4 240 156 €
BP CAPITAL 3.2%16	3 865	2 972 570 €
BPCE 1.625% 17	3 700 000	3 791 245 €
BPCE 1.7% 16	3 250 000	2 383 576 €
BPCE 2.50% 13-2018	12 650 000	9 085 760 €
BPCE 2.875% 09/15	600 000	625 638 €
BPCE 3.75 07/17	12 250 000	13 418 442 €
BPCE 4.25% 02/2023	5 600 000	6 535 482 €
BPCE 4.625% 23	18 100 000	19 404 730 €
BPCE 5.7% 2023	6 081 000	4 596 284 €
BPCE SFH 4% 03/22	3 000 000	3 506 314 €
BRAMBLES 4.625% 18	13 815	15 832 845 €
BRANDYWINE 6% 0416	4 600 000	3 683 216 €
BRE Finan 2.75% 15	4 000 000	4 117 118 €
BRITAM TOB 3.625% 21	2 800	3 033 633 €
BRK 5.75%01/04/2018	5 800	4 870 264 €
BROADCOM 2.70% 11/18	7 675	5 708 236 €
BROADRID 3,95% 2020	6 071 000	4 483 669 €
BROWN-FORMAN 2.25%23	5 650 000	3 672 469 €
BSH BOSCH 1.875% 20	5 400 000	5 315 079 €
BT TEL.6,5%070715	839	937 548 €
BTP 4.25 01/03/20	5 000	5 383 151 €
BURL 4.70000 10/19	3 565	2 880 441 €
BURL NTHN 5.15% 43	925 000	690 423 €
BURLINGTON 4.4% 42	8 115 000	5 338 071 €
BURLINGTON 4.45%43	12 150 000	8 148 770 €
BURLINGTON 4375 0942	1 500 000	980 254 €
C AGRICOLE 2.625%18	15 305 000	11 238 565 €
C AGRICOLE 7.875%19	400 000	462 998 €
CA INC 5.375%09-2019	7 100	5 763 453 €
CA LONDON 2.375% 20	11 900 000	11 965 364 €
CA LONDON 2.375% 20	14 600 000	14 680 194 €
CADES 2.50% 10/22	4 400 000	4 486 944 €
CADES 3,625%250415	40 000 000	42 778 186 €
CADES 3,625%250416	72 900 000	79 996 426 €
CADES 4,125%17EMTN	6 200 000	7 056 043 €
CAIXA 5.125 04/16	30	1 680 772 €
CAIXABANK 2.5% 17	5 000 000	5 102 397 €
CAIXABANK 3% 2018	3 600 000	3 823 220 €
CAMDEN PROP 2.95%22	3 400 000	2 218 873 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
CAMDEN PROP 4.25%24	1 150 000	825 818 €
CAMERON 5.125% 43	2 300 000	1 645 783 €
CAN NATL 5.7% 05/17	6 220	5 107 744 €
CAN NATL 5.9% 02/18	4 545	3 824 716 €
CANADIAN NATL 6.2%36	605	522 835 €
CANADIAN PAC 5.75%42	2 365 000	1 893 789 €
CAPITA OBAK 3.375 23	1 128 000	769 125 €
CAPITAL 6,15%16 SR	8 500	7 025 681 €
CAPITAL FIN 2.15% 15	3 000 000	2 223 713 €
CAPITAL ONE FI 1%15	2 825 000	2 051 240 €
CARDINAL HEALTH	2 690 000	1 842 289 €
CARLSB BR 2.625%2019	5 000 000	5 147 443 €
CARLSB BR 3.375% 17	1 000	1 071 140 €
CAROLINA P 4.1% 43	350 000	233 692 €
CAROLINA P 6.3 38	1 760	1 557 004 €
CARREFOUR 1.75%2019	9 500 000	9 386 850 €
CARREFOUR 1.875% 17	2 500 000	2 530 687 €
CARREFOUR 2.875%15	938 000	976 573 €
CARREFOUR 3.875%21	5 000 000	5 522 840 €
CARREFOUR BQE TV 16	800 000	811 515 €
CASINO 3.157%2019	3 300 000	3 457 652 €
CASINO 4.726% 21	3 900 000	4 472 297 €
CATERPILLAR 1.10%15	1 310 000	959 346 €
CATERPILLAR 1.375%14	2 655	1 936 416 €
CB AUS 4.25 04/18	4 000	4 567 162 €
CBAAU 4.375% 02-20	7 338	8 558 506 €
CBL & ASSOC 5.25% 23	5 670 000	4 130 361 €
CBS 5.90% 151040	7 500	5 713 395 €
CBS CORPO 4.85%2042	2 125 000	1 390 686 €
CEFELEC 4.875%2021	1 255	945 059 €
CELGENE 3.25% 08/22	4 250 000	2 963 277 €
CELGENE COR 5.7%40	1 500 000	1 158 105 €
CELLCO PART/VERI	2 992	2 783 070 €
CENOVUS 6.75% 2039	1 625	1 384 219 €
CENOVUS EGY 3.80% 23	3 535 000	2 532 207 €
CENTERP EN 6.5% 18	1 345	1 147 448 €
CENTRI PLC 5.375% 43	1 530 000	1 107 581 €
CEZ AS 4.5% 06/20	2 993	3 424 644 €
CEZ AS 4.875% 04/25	5 689	6 715 204 €
CEZ AS 5% 2021	7 000 000	8 190 363 €
CEZCO 5.75%05-15	1 110	1 223 881 €
CF INDUSTRIE 3.45%23	790 000	523 017 €
CFSC 7.15 02/19	6 600	6 002 097 €
CHEVRON 3.191%23	2 180 000	1 515 374 €
CHURCH DWI 2.875% 22	3 000 000	2 021 221 €
CISCO SYS 4.45% 20	4 800	3 869 184 €
CISCO SYS 5.5% 40	5 650	4 438 832 €
CISCO SYSTEM 5.9% 39	1 560 000	1 280 729 €
CITIGROUP 3.875% 23	800 000	571 451 €
CITIGROUP 1.75% 2018	6 000 000	4 283 778 €
CITIGROUP 3.375%2023	22 575 000	15 735 470 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
CITIGROUP 3.625% 17	500	493 482 €
CITIGROUP 4 3/8%18	1 500 000	1 693 592 €
CITIGROUP 4% 11/15	1 000	1 060 723 €
CITIGROUP 4.45% 2017	21 690 000	17 380 107 €
CITIGROUP 4.75 15	6 123	4 696 706 €
CITIGROUP 5%19EMTN	9 901	11 568 099 €
CITIGROUP 6 1/8%36	2 175	1 705 744 €
CITIGROUP 8.125% 39	2 849	2 973 438 €
CITIGROUP TV17 S.B	1 000	973 722 €
CITIGROUP TV260230	2 400	2 442 571 €
CITIGROUP7.375%04/19	16 749	21 729 395 €
CITIGRP 4,75%19MTN	4 929	5 087 986 €
CITIGRP 6.675%43	3 810 000	3 215 376 €
CITY NATIONAL	1 900	1 505 532 €
CITYCON OY 3.75% 20	3 300 000	3 386 945 €
CLERICAL 4.25% 2015	1 500 000	1 531 518 €
CLOVERIE 6.625% 42	8 180 000	10 037 198 €
CME GROUP 5.3% 43	2 000 000	1 539 001 €
CME GRP 4.4% 03/2018	2 635	2 090 821 €
CNA FIN 7.35% 1119	2 865	2 540 725 €
CNA FIN CP 5.75% 21	3 000	2 473 657 €
CNOOC CURTIS 4.50%23	1 500 000	1 096 097 €
CNP ASS.4,75%PERP.	4 450 000	4 468 254 €
CNP ASSUR 8.875 2041	3 700 000	4 211 484 €
CNP ASSURANCES	1 000 000	1 085 460 €
COCA 3.875% 2023	8 000 000	5 740 942 €
COCA-COLA 2% 2019	2 200 000	2 177 810 €
COCA-COLA 2.375% 20	11 740 000	11 769 043 €
COCA-COLA F 2.375%18	8 934 000	6 463 349 €
CODELCO 5.625% 2043	1 500 000	1 092 377 €
CODELCO 7.5 01/19	488	433 500 €
COLA ENT3.125% 09/17	500	535 428 €
COM BK AUST 1.625%19	1 900 000	1 909 745 €
COM BK AUSTRALIA	800	877 374 €
COMCAST 4.25% 33	3 025 000	2 066 518 €
COMCAST 4.5% 2043	13 700 000	9 181 704 €
COMCAST 6,30%17 SR	1 500	1 278 614 €
COMCAST 6,50%35 SR	3 818	3 242 150 €
COMCAST 7.05% 03/33	3 000	2 679 637 €
COMCAST CORP 5.7%19	2 355	1 979 116 €
COMCAST CORP 6.55%39	2 009	1 697 217 €
COMERICA BK 5.75%16	6 450 000	5 292 602 €
COMMERZBK 3.875% 17	4 000	4 420 991 €
COMMONLTH ED 1.95%16	7 600	5 656 900 €
COMMONW.5.875%2020	5 500	4 172 578 €
COMPASS GRP 3.125%19	4 500 000	4 880 550 €
CON EDISON NY	9 500	7 464 149 €
CONAGRA 1.90% 18	4 300 000	3 107 451 €
CONAGRA 2.1%15/03/18	3 016 000	2 181 845 €
CONOCO FND 7.25 31	5 200	4 976 484 €
CONOCOPHIL 5.2 18	3 350	2 773 376 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
CONOCOPHIL 6.5%2039	4 000	3 700 606 €
CONOCOPHIL 6.95 29	1 160	1 075 854 €
CONST ENER 5.15% 20	3 400 000	2 602 218 €
CONT AIRLN 7.25% 21	605	411 231 €
CONTINENTL 3.125% 20	1 526 000	1 608 539 €
CONTL AIRL 9%16	1 345	904 713 €
CORIO 3.25% 2021	4 564 000	4 650 446 €
CORN PROD.3.2%10-15	2 500	1 889 647 €
COV BLDG STE 2.25%17	16 010 000	16 359 886 €
COVENTRY 5.45%11-21	4 225	3 402 167 €
COVENTRY BG 2.5%20	16 797 000	16 645 427 €
COVIDIEN FI 6.55%37	2 100	1 888 030 €
COVIDIEN I 4.20 20	328	252 833 €
COVIDIEN I 6% 10/17	4 039	3 399 015 €
COVIDIEN INTL3.2% 23	2 700 000	1 811 426 €
COX 3.375%09-2039	2 975	2 633 562 €
COX 5.45%04-2014	1 535	1 165 904 €
COX COMMUN 4.5% 2043	1 175 000	691 006 €
COX COMMUN 4.7% 22	3 165 000	1 871 532 €
CR AGRICOLE 3.875%19	12 800 000	14 454 346 €
CR.AGRIC.5,971%18	10	599 928 €
CRDT SUISS 1.625%15	1 890 000	1 396 297 €
CRED AGRI 3.9% 21	3 450 000	3 698 347 €
CRED.AGRIC.8.2% 2018	200 000	245 822 €
CRED.LOG.TV0617	9 250 000	9 020 414 €
CRED.LOGEMT PERP.	11 400 000	9 213 166 €
CREDIT LOG 5.454%21	5 000 000	5 921 068 €
CREDIT SUISSE LONDON	5 995	6 979 925 €
CRH 7.375% 05/14	1 000	1 070 508 €
CRH AMERIC 6 09/16	3 500	2 879 962 €
CRH FINANC 5%12-2019	7 100 000	8 358 385 €
CRH FINANCE 3.125%23	5 155 000	5 232 487 €
CROWN 5.495%10-2017	3 650	2 856 651 €
CROWN CST 6.113 20	800	648 945 €
CS 3.875%01-2017	2 900	3 249 719 €
CS AG 5.75% 09/25	4 000 000	4 343 275 €
CS NY 5.3 08/19	2 095	1 742 538 €
CSX CORP 6.15% 2037	370	301 772 €
CSX CORP 6.25 18	3 000	2 548 227 €
CSX CORP 6.25% 2015	1 880	1 478 954 €
CVS 4% 05/12/23	5 425 000	3 932 522 €
CVS 5.30% 05/12/43	4 445 000	3 322 746 €
CVS CAREM 6.125 %39	2 600	2 165 318 €
CVS CAREMARK 2.25%18	2 400 000	1 743 205 €
CVS CARRK 2.75% 22	8 400 000	5 610 203 €
DAIGR 2.25% 2019	8 300 000	5 914 691 €
DAIMLER 2% 21	4 200 000	4 157 475 €
DAIMLER 2.625% 2019	3 000 000	3 190 455 €
DAIMLER AG 2% 20	2 340 000	2 339 219 €
DAIMLER AG 2.375% 22	5 027 000	5 015 528 €
DAIMLER FI 1.30% 15	1 800 000	1 323 061 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
DAIMLER FIN 1.25% 16	4 300 000	3 150 982 €
DAIMLER FIN. LIB3M16	5 250 000	3 828 207 €
DAIMLER FIN.2.375%18	3 710 000	2 713 574 €
DAIMLER INT 6.125%15	10	555 023 €
DAIMLER NA 8.5% 2031	2 100	2 266 864 €
DANAHER 3.9% 2021	1 450	1 089 124 €
DANONE 1.125% 17	5 100 000	5 075 127 €
DANONE 2.25% 21	4 800 000	4 782 602 €
DANSKE BANK 2.5% 15	1 000 000	1 037 877 €
DANSKE BANK 3.75%15	2 850	2 157 068 €
DANSKE BANK 3.875%16	2 822 000	3 083 871 €
DANSKE BK 3.875% 16	2 520	1 943 296 €
DANSKE BK 3.875% 23	9 973 000	10 254 333 €
DANSKEB 3.875% 2017	13 900 000	15 482 422 €
DB AG 5 24/06/20	100	5 644 997 €
DCP 4.95%12-2042	1 660 000	1 235 443 €
DCP MIDST 5.35% 20	1 355	1 047 699 €
DEERE 3.9% 2042	5 460 000	3 440 624 €
DEERE CCJ 5.35% 2018	2 175	1 808 571 €
DELTA AIRL 4.95% 19	2 000	1 186 677 €
DELTA LLOYD 9% 42	3 500 000	4 322 097 €
DELTALL 4.125% 2017	4 200	4 534 748 €
DEU TELEK 4.875 25	2 000	2 375 925 €
DEU TELEKO 4.25 20	6 500	7 494 342 €
DEU TELEKO 4.25% 22	3 734 000	4 227 484 €
DEU.TEL.6 5/8%0318	80	100 627 €
DEUTSCH 8% 05/2099	1 000	1 137 396 €
DEUTSCHE 2.125% 2016	12 300 000	12 597 736 €
DEUTSCHE 2.375%2022	3 500 000	3 473 720 €
DEUTSCHE 3.125%2019	15 600 000	16 150 161 €
DEUTSCHE AN 3.625%21	6 715 000	6 936 517 €
DEUTSCHE BK 6%17	1 800	1 518 620 €
DEUTSCHE TEL 2.25%17	1 800 000	1 335 088 €
DEUTSCHE TEL 6%01-17	4 597	5 512 394 €
DEUTSCHE TVPERP.	977	931 886 €
DEVON ENER 1.2% 16	5 964 000	4 319 482 €
DEXIA 5.375% 07/14	2 700	2 823 760 €
DIAMOND 5.7% 2039	1 565	1 237 002 €
DIGITAL 5.25%11-21	700	524 102 €
DIGITAL 5 7/8%20	4 900	3 883 426 €
DIREC HLDG 3.125%16	1 300	992 487 €
DIRECTTV 3.55% 0315	6 500	4 918 828 €
DIRECTV 2.4% 03/17	3 050 000	2 270 024 €
DIRECTV 3.5%11-2016	2 500	1 923 367 €
DIRECTV 3.8% 03/22	2 000 000	1 402 347 €
DIRECTV 4.6%150221	3 440	2 602 648 €
DIRECTV 5.15%12-1503	6 420 000	4 231 074 €
DIRECTV 6.375%11-41	1 746	1 339 823 €
DIRECTV HLD 2.75%23	9 760 000	9 290 584 €
DISCO COM 3.3% 05/22	2 800 000	1 929 732 €
DISCOVER 3.85% 2022	1 629 000	1 111 965 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
DISCOVER BK 2% 18	2 000 000	1 438 653 €
DISCOVER BK 4.20%23	2 000 000	1 450 173 €
DISCOVER BK 8.7%19	1 691	1 548 273 €
DISCOVERY 4.875%2043	2 845 000	1 910 324 €
DISCOVERY 5.625%19	4 600	3 825 225 €
DNB BANK 4.75%2022	3 050 000	3 392 703 €
DNB BK ASA 3% 23	5 140 000	5 218 660 €
DNB NORBK 4.375% 21	8 435	9 818 312 €
DOMINION RES 5.2%19	7 255	5 997 797 €
DOMINIRES 6 11/17	2 565	2 134 373 €
DONG 6.5%09-2019	1 130	1 433 181 €
DONG DNK 4 12/16	450	487 949 €
DONG EN 4.875%12-21	1 763	2 038 512 €
DONG ENE.5,50%3005	900 000	967 726 €
DOW CHEMI 7.375% 29	1 900	1 782 456 €
DOW CHEMICAL 8.55%19	6 150	5 813 879 €
DOW CHEMICAL 9.4%39	850	923 802 €
DT 3.125% 2016	2 920	2 219 358 €
DTE ELECTRIC 3.65%24	8 975 000	6 547 205 €
DTE ENERGY 3.85% 23	3 150 000	2 268 564 €
DTSCH POS 1.875% 17	4 800 000	4 952 229 €
DUKE 3.875% 02/21	1 120 000	802 794 €
DUKE 7.375% 15/02/15	7 000	5 580 621 €
DUKE ENERGY 3.8% 23	4 550 000	3 325 395 €
DUKE ENERGY 4.2%42	2 130 000	1 443 852 €
DUKE ENERGY 4.9%13	1 850 000	1 405 846 €
DUKE ENERGY 5.05% 19	2 040	1 660 753 €
DUKE ENERGY CAR	4 700	3 653 742 €
DVB BANK 1.625% 18	5 000 000	5 020 990 €
E.ETAT 3,75%05 OAT	1 106 405 692	1 279 404 802 €
E.ETAT 4,25%03OAT	792 189 567	934 164 370 €
E.ETAT 6%25 OAT	8 450 000	11 365 335 €
E.ETAT 8,50%92 OAT	1 079 764 356	1 703 680 748 €
E.L.M.TV-PERP.	171	8 990 696 €
E.ON INT.5,75%0520	3 000	3 746 815 €
E.ON INTL 6 3/8%17	2 280	2 754 158 €
EANDIS 2.75% 22	1 900 000	1 905 468 €
EASTMAN CHEMI 2.4%17	1 358 000	1 000 926 €
EASTMAN CHEMI 3.6%22	5 132 000	3 617 689 €
EATON 4.15%13-2042	875 000	567 723 €
EATON 2.75%2022	8 250 000	5 595 791 €
EATON CORP 5.6 18	2 550	2 099 375 €
EATON VANCE 3.625%23	2 825 000	1 963 240 €
EBAY 4%12-2042	750 000	464 996 €
ECOLAB INC 5.5% 41	3 950	3 043 434 €
EDENRED 2.625% 20	8 000 000	7 923 203 €
EDENRED 3.625% 2017	9 500 000	10 214 086 €
EDF 2.75% 2023	7 100 000	7 230 948 €
EDF 3.875% 18/01/22	4 000 000	4 514 744 €
EDF 4.25% 49	12 000 000	12 848 303 €
EDF 4.6%10-27/01/20	4 700	3 757 533 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
EDF 4.625 04/30	900 000	1 044 379 €
EDF 4.625% 11/09/24	2 000 000	2 320 951 €
EDF 6.50%19	1 590	1 399 462 €
EDF SA 5.25% 12/2049	5 725 000	4 202 596 €
EDWARDS LIF 2.875%18	2 285 000	1 665 513 €
EL PASO OP 6.50% 20	3 238 000	2 723 860 €
ELISA CORP 2.25% 19	3 500 000	3 489 586 €
ELISA CORP 2.75% 21	600 000	603 393 €
ELM 5.849%07-2017	5 350 000	5 724 213 €
EMBARQ 7,995%36 SR	1 630	1 207 320 €
EMC 1.875%13-2018	5 450 000	3 920 025 €
ENAGAS FIN 4.25%17	5 000 000	5 503 244 €
ENCANA 6.5% 2034	2 000 000	1 610 492 €
ENEL 3.5% 26/02/16	2 700	2 894 345 €
ENEL 4.875% 2023	2 100 000	2 385 916 €
ENEL 5% 2021	1 000	1 141 244 €
ENEL 5,25%200617	7 335	8 355 864 €
ENEL 5,625%27	1 000 000	1 157 468 €
ENEL FI 4% 09-16	1 000	1 076 223 €
ENEL FI 5%09-22	5 000	5 603 382 €
ENEL FIN 3.625%2018	1 830 000	1 986 134 €
ENEL FIN 5.75% 2018	18 299	21 296 880 €
ENEL FIN 4.625% 2015	2 004	2 152 227 €
ENEL FIN 4.875% 20	18 685 000	21 467 795 €
ENEL FINA 3.875% 14	560	418 921 €
ENERGY TRA 5.15%2043	3 370 000	2 262 230 €
ENERGY TRA 6.7% 18	1 525	1 284 392 €
ENERGY TRAN 4.15%20	7 440 000	5 539 016 €
ENERGY TRAN 4.90%24	4 000 000	2 977 005 €
ENEXIS 1.875% 2020	7 670 000	7 559 122 €
ENI 4.25%12-03/02/20	4 800 000	5 493 455 €
ENI 5%01-16	70	3 947 392 €
ENI SPA	18	1 015 972 €
ENI SPA 2.625% 2021	9 314 000	9 307 818 €
ENI SPA 3.25% 2023	5 256 000	5 418 024 €
ENI SPA 3.75% 25	3 050 000	3 171 932 €
ENI SPA 3.75%12-2019	2 400 000	2 639 133 €
ENI SPA 3.75%13-2025	2 670 000	2 777 168 €
ENI SPA 4.125%09-19	64	3 553 880 €
ENI SPA 4.875 17	5 000 000	5 658 900 €
ENSCO PLC 3.25% 16	10 860	8 308 115 €
ENSCO PLC 4.70% 2021	2 000	1 555 921 €
ENT PRODT TF/TV 66	2 375 000	1 958 671 €
ENTER PRODU 5.20% 20	6 350	5 210 814 €
ENTERGY 5.59% 24	2 235 000	1 835 804 €
ENTERGY M 3.1% 2023	1 690 000	1 143 262 €
ENTERPRISE 5.25%2020	2 780	2 290 075 €
ENTERPRISE 6.125%39	3 845	3 083 454 €
ENTERPRISE 7% 2067	1 175 000	874 906 €
ENTR PRODU 6.45% 10	4 500	3 788 393 €
EOG RESOUR 2.625% 23	1 400 000	927 739 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
EON INTL F 5.8 18	2 770	2 314 994 €
ERICSSON 5,375%17	1 100	1 281 072 €
ERP OPERAT 4.625%21	3 200 000	2 439 998 €
ERSTE GRP 1.875% 19	11 000 000	10 848 904 €
ERSTE GRP 7.125%2022	4 688 000	5 488 561 €
ESB FIN LTD4.375% 19	14 380 000	15 779 515 €
ESB FINAN 3.494% 24	1 956 000	1 952 704 €
ESB FINANCE 6.25% 17	3 306 000	3 880 002 €
ESE PRODT 6.65 34	1 425	1 218 818 €
ESPA 4.4% 31/10/23	14 000 000	14 390 834 €
ESPAGNE 3,15% 2016	5 500	5 829 959 €
ESPAGNE 5,50%17	2 000	2 267 439 €
ETP 6.50% 2042	8 200 000	6 433 040 €
ETP 9% 15/04/2019	1 222	1 136 631 €
EUREKO 7.375%09-2014	900	963 413 €
EUREKO TV 05/2049	1 026	10 693 901 €
EUROGRID 3.875% 2020	25	1 375 998 €
EUTEL 4.15% 03/2017	3 700 000	4 111 954 €
EUTELSAT SA 2.625%20	1 900 000	1 883 880 €
EUTLSAT SA 5% 19	5 000 000	5 841 771 €
EVI 7%38 SR	1 640	1 313 813 €
EXELON GEN 5.20% 19	2 650	2 121 177 €
EXPNL 4.75%02-20	12 329	14 483 567 €
EXPNLN 2.375% 2017	1 350 000	963 964 €
EXPRESS 2.10%2015	2 150 000	1 595 531 €
EXPRESS 4.75% 2021	7 000 000	5 404 611 €
EXPRESS 6.125%2041	955 000	783 176 €
FCE BANK 1.75% 2018	1 200 000	1 200 945 €
FCE BANK 2.875%2017	1 500 000	1 570 639 €
FEDEX 2.625% 2018	2 910 000	1 766 080 €
FERROV 3.5% 13/12/21	21 789 000	21 773 778 €
FERROVIAL 3.375%21	2 000 000	2 041 370 €
FERROVIAL 3.375%2018	4 800 000	5 143 876 €
FGA CAPITL 4% 18	4 857 000	5 015 857 €
FIDEL NTL 5% 03/22	1 500 000	1 123 402 €
FIDELITY NATL 3.5%23	1 550 000	1 029 019 €
FIFTH THIR 3.62 %16	4 500	3 476 818 €
FIFTH THIR 4.50 18	2 500	1 952 818 €
FIFTH THIRD 4.30% 24	1 675 000	1 192 709 €
FIRST NIAG6.75%03/20	6 045	5 075 503 €
FLA GAS 5.45%0720	4 314 000	3 526 207 €
FLORID PWR 6.4% 38	5 680	5 071 121 €
FLORIDA PW 5.4 35	415	334 102 €
FLORIDA PW 5.95% 38	790	682 871 €
FLUOR CORP 3.375%21	1 500	1 069 645 €
FMS 1.625% 11/2018	4 170 000	2 994 073 €
FNMA 0 09/10/19	829	2 552 398 €
FONC.LYON.4,625%16	2 800 000	3 078 256 €
FORD CRED 6.625%17	5 585 000	4 791 321 €
FORD MOT CRED 8.7%14	1 200 000	941 440 €
FORD MOTO 8.125% 20	1 400 000	1 302 525 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
FORD MOTOR 2.375%18	7 185 000	5 321 798 €
FORD MOTOR 2.75% 15	800 000	597 254 €
FORD MOTOR 5%18	3 606 000	2 924 666 €
FORD MOTOR 7,45%31	2 427 000	2 207 445 €
FORD MTR 4.75%2043	2 750 000	1 831 163 €
FORDMOTOR4.25%17	14 470 000	11 464 500 €
FORTIS 5,757%17	7 900	9 052 422 €
FORTIS BANK TV21	805	860 868 €
FORTIS BK 4 5/8%PL	427	21 706 899 €
FORTIS BK 4% 02/15	4 329	4 639 353 €
FORTIS BK 4,375%17	1 000	1 125 264 €
FORTUM 2.25% 09/22	1 660 000	1 602 797 €
FORTUM 6%09-2019	7 000	8 713 110 €
FPL CAPIT 6.35% 66	1 500	1 101 499 €
FRA.E.ETAT 4%14OAT	415 782 237	432 166 051 €
FRA.TEL.5 5/8%18	3 910	4 681 916 €
FRA.TELECOM.8 1/8%33	2 527 000	3 918 222 €
FRANCE TE 3.375 22	500 000	525 643 €
FRANCE TELECOM 2.75%16	850	643 484 €
FRCE TEL 3.875% 2020	2 000 000	2 225 693 €
FRCE TEL 3.875%21	4 500 000	5 048 958 €
FREEPORT-MC 3.55% 22	9 740 000	6 772 876 €
FREEPRT-MC C&G 0318	4 470 000	3 259 097 €
FREEPRT-MC C&G 0320	9 289 000	6 612 848 €
FREEPRT-MC C&G 0323	3 675 000	2 540 916 €
FRTEL8.5% 01/03/2031	5 400	5 487 284 €
G4S INTL 2.875%2017	1 687 000	1 755 885 €
G4S PLC 2.625% 18	2 200 000	2 200 879 €
GAP INC 5.95% 21	2 775 000	2 248 766 €
GAS NAT 4.125 18	69	3 884 033 €
GAS NAT 5.375 19	17	2 009 329 €
GAS NAT 5.6250 17	39	4 585 036 €
GAS NAT FENO 3.5% 21	10 800 000	11 304 977 €
GAS NATL 3.875% 23	1 900 000	2 054 455 €
GAS NATUR 4.125%17	2 200 000	2 441 878 €
GAS NATURAL 4.375%16	40	2 181 882 €
GAS NATURAL 5.125%21	300	345 566 €
GAS NATURAL 6% 20	9 600 000	11 935 276 €
GASSM 3.375% 01/2015	10	528 219 €
GATX CORP 4.85% 21	7 300	5 411 373 €
GAZ C.5,136%220317	400	448 855 €
GAZPROM 3.755% 03/17	3 560 000	3 814 734 €
GDF SUEZ 1.625% 17	2 550 000	1 839 857 €
GDF SUEZ 2.625% 2022	2 412 000	2 452 030 €
GDF SUEZ 3% 2023	7 585 000	7 996 888 €
GDF SUEZ 5.95% 11	2 000 000	2 618 604 €
GE 4.125%35 EMTN	2 000	2 038 577 €
GE 4.65% 2021	6 000	4 760 610 €
GE CAP 2.25% 20	700 000	702 734 €
GE CAP 2.625% 2023	5 285 000	5 301 698 €
GE CAP 3.75% 04/16	750	816 794 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
GE CAP 5.5%09-2067	4 777	5 142 046 €
GE CAP 6.025% 03/38	2 496 000	3 395 200 €
GE CAP EUR 4.25%17	6 000	6 757 874 €
GE CAP FUND 2% 0215	1 177 000	1 213 817 €
GE CAP FUND 2.875%19	1 166 000	1 232 230 €
GE CAP FUND2.875%15	4 000	4 170 213 €
GE CAPIT 4,125%16	22 049	24 030 852 €
GE CAPITAL 4,35%21	1 000	1 126 147 €
GE CAPITAL E 1% 2017	4 575 000	4 566 179 €
GE CAPITAL EUR FUND	514	32 086 978 €
GE EUR FUND 5.375%20	340	416 166 €
GEA GROUP 4.25% 2016	4 500	4 925 583 €
GECAP TRUST 4.625%66	9 600	9 949 714 €
GECC 2.25 11/15	2 023	1 515 631 €
GECC 5.30% 02/2021	2 500	2 068 070 €
GECC 5.625 09/17	5 000 000	4 184 316 €
GECINA 2.875% 23	1 700 000	1 646 310 €
GECINA 4.75% 04/19	3 000 000	3 424 251 €
GEN ELEC 5.25%23	1 800 000	1 224 001 €
GEN ELECTR 4.125%42	2 770 000	1 849 700 €
GEN ELECTRIC 2.7%22	9 550 000	6 518 417 €
GEN MILLS 5.7% 17	1 600 000	1 327 220 €
GENENTECH 4.75% 15	1 700 000	1 339 054 €
GENERAL 5,875%38	9 350	7 820 706 €
GENERAL ELEC TV 2067	1 000 000	1 076 847 €
GENERAL MIL 2.1% 20	5 365 000	5 310 662 €
GENERALI 4.875 %14	2 000	2 081 239 €
GENERALI FI 5.479%49	4 000 000	4 198 466 €
GENERALI TVPERP.	75	3 867 026 €
GENWORTH 4.80% 2024	1 175 000	843 210 €
GENWORTH 4.90%2023	3 430 000	2 533 890 €
GENWORTH 6.515%18	1 650	1 368 226 €
GENWORTH 7.625%2021	650	570 208 €
GEORGIA CY 4.3% 42	9 585 000	6 292 045 €
GEORGIA POW 2.85% 22	4 720 000	3 221 882 €
GEORGIA POWER 4.3%43	3 300 000	2 159 258 €
GILEAD 4.5%11-2021	3 000	2 343 555 €
GILEAD SC 5.65%11-41	8 000	6 402 398 €
GL ELEC.6,75%32	4 387	3 987 183 €
GLAXOSM 1.50% 17	3 000 000	2 182 575 €
GLAXOSMITH 2.8% 2023	4 125 000	2 791 403 €
GLENCORE 4.125% 18	7 794 000	8 804 539 €
GLENCORE 5.25% 03/17	154	8 845 085 €
GLENCORE FD 4.125%23	4 820 000	3 268 376 €
GLENCORE FDG 2.5%19	2 770 000	1 961 485 €
GLENCORE FI 3.375%20	14 938 000	15 548 541 €
GN FENOSA 3.875%2022	1 900 000	2 053 262 €
GOLDCORP 2.125% 2018	2 545 000	1 822 655 €
GOLDMAN 3.625%2023	10 795 000	7 682 821 €
GOLDMAN 3.70%10-2015	9 335	7 161 986 €
GOLDMAN 4,50%17MTN	4 000 000	4 521 524 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
GOLDMAN 4.375%10-17	176	9 863 475 €
GOLDMAN 5,35%16	7 100	5 702 427 €
GOLDMAN 5.125% 10/19	78	4 489 098 €
GOLDMAN 5.75%12-2022	1 900 000	1 578 321 €
GOLDMAN 5375 0320	6 695	5 474 716 €
GOLDMAN 6,375%18	7 400	9 076 172 €
GOLDMAN 6,75%37	2 130	1 728 505 €
GOLDMAN LIBOR 11/23	3 675 000	2 693 879 €
GOLDMAN SAC 6.25%41	7 675	6 513 472 €
GOLDMAN SACHS 6% 20	2 000	1 664 388 €
GOODMAN 6.375% 2020	7 700	6 268 593 €
GREAT 5.292%2022	1 845 000	1 380 044 €
GREAT-WEST 2.5%2023	23 760 000	23 407 965 €
GRUPO TV 6.625%2040	1 625	1 284 054 €
GS CALTEX 3.25% 18	3 000 000	2 194 179 €
GSACHS G 2.625% 2020	7 721 000	7 791 404 €
GSACHS G 3.25% 23	1 000 000	1 037 885 €
GSACHS G 3.625% 16	951	733 927 €
GSACHS G 6% 05/14	7 675	5 724 826 €
GSACHS G 6.15% 18	6 144	5 183 091 €
GUARDI 7.375% 09/39	1 078	1 012 374 €
HALLIBURTO 3.50% 23	5 000 000	3 564 666 €
HAMMERSON 2.75%2019	2 010 000	2 065 667 €
HAMMERSON 4,875%15	3 122	3 378 959 €
HANNOVER 5.75%2040	20	1 132 909 €
HANNOVER FI 5%06/49	3 500	3 698 485 €
HANNOVER FIN.5%2043	1 000 000	1 088 237 €
HANNOVER FIN.TV24	3 200	3 378 482 €
HARLEY-DAVID 6.8%18	7 750	6 606 070 €
HARTFORD 6.625% 0340	6 500	5 739 127 €
HARTFORD FINL 4.3%43	3 000 000	1 922 610 €
HCN 4.125% 04/2019	11 230 000	8 646 794 €
HCP 2.625%12-2020	2 275 000	1 587 831 €
HCP INC 4.25% 23	5 200 000	3 707 420 €
HCP INC 6.75% 02/41	1 500	1 311 390 €
HEALTH CARE 4.50%24	4 275 000	3 080 194 €
HEALTH CARE 6%17	3 000	2 490 551 €
HEALTH SVC 4.70 21	1 480	1 151 041 €
HEALTHCARE 3.75%23	900 000	603 016 €
HEINEKEN 2.125%2020	10 100 000	10 049 136 €
HEINEKEN NV 1.4%17	5 840 000	4 183 551 €
HEINEKEN NV 2% 21	8 700 000	8 530 246 €
HEINEKEN NV 3.5% 24	2 460 000	2 639 767 €
HENKEL 5,375% 2104	1 000	1 068 715 €
HERA 4,125%16	500	548 108 €
HERA SPA 3.25% 21	5 986 000	6 075 849 €
HERA SPA 4.5 % 19	3 913	4 326 376 €
HESS CORP 5.6%10-41	10 970	8 352 958 €
HEWLETT 2.625%11-14	1 805	1 334 538 €
HEWLETT-PACK 2.6% 17	2 800 000	2 088 319 €
HEWLETT-PACK 3.30%16	4 000	3 047 376 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
HIG 5.125% 2022	2 510 000	2 000 515 €
HIT FIN BV 5.75 18	28	3 333 772 €
HIT FIN.4,875%1021	14	787 817 €
HOLCI US 2.625 0920	3 200 000	3 253 831 €
HOLCIM FI.4,375%14	1 000	1 036 916 €
HOME DEPOT 4.2% 43	740 000	495 591 €
HOME DEPOT 4.875%44	1 110 000	823 053 €
HOME DEPOT 3.75%24	4 000 000	2 913 342 €
HOME DEPOT 5.95%41	1 350	1 145 302 €
HONEYWELL 3.35% 2023	3 020 000	2 141 457 €
HONEYWLL 5.7 03/37	985	810 600 €
hospitality 5 0822	3 665	2 730 925 €
HOST H&R 5.875% 19	2 395 000	1 886 585 €
HOST H&R 6% 10/21	775 000	616 723 €
HOST HOTELS 3.75%23	950 000	642 646 €
HOWARD HUGHES 3.5%23	4 920 000	3 558 705 €
HSBC 4 7/8%17	36	2 061 319 €
HSBC 4% 30/03/2022	3 350 000	2 507 569 €
HSBC 4,50%140616	2 000	2 211 375 €
HSBC 4.875% 2022	4 735	3 786 597 €
HSBC 6.1% 2042	1 050	927 233 €
HSBC 6.5%15/09/37	2 495	2 171 788 €
HSBC BANK 3.875% 18	3 000	3 335 449 €
HSBC BANK 5.13%16	1 942 000	2 114 887 €
HSBC CAP FD TV-PER	500	522 426 €
HSBC FIN.3,75%15	5 700	6 016 422 €
HSBC FINCE 6.676% 21	3 240	2 807 203 €
HSBC FRCE 1.875% 20	7 300 000	7 344 722 €
HSBC HLDGS 6,5%36	3 000 000	2 583 574 €
HSBC HOLD 3.375% 24	16 700 000	17 186 320 €
HSBC HOLD 6% 06/19	4 000	4 777 202 €
HSBC USA 1.625%2018	4 325 000	3 121 362 €
HSBC USA 5% 27/09/20	6 200	4 909 739 €
HSBCBANK 3.125% 17	1 000	1 070 392 €
HSBCBANK 3.875 16	1 000	1 095 625 €
HSBCBANK 4% 01/21	1 000	1 165 314 €
HUMANA INC 3.15% 22	3 200 000	2 156 400 €
HUMANA INC 7.2% 2018	835 000	720 473 €
HUNTINGTON 1.35%16	4 666 000	3 406 783 €
HUTCHISON 4.75 16	130	7 174 292 €
HWLTT PCKD 4.65% 21	2 400	1 795 476 €
HWLTT PCKD 4.75% 14	7 520	5 571 186 €
HYUNDAI CAP 1.875%16	5 625 000	4 131 680 €
HYUNDAI SV 4.37% 16	6 400	5 035 990 €
HYUNDAI SV 6% 15	4 500	3 496 070 €
IBERDR FIN 3.5% 16	124	6 623 836 €
IBERDROLA 2.875% 20	3 900 000	3 973 402 €
IBERDROLA 3% 22	13 000 000	13 027 799 €
IBERDROLA 3.80%2014	545	407 731 €
IBERDROLA 4.125%2020	67	3 770 998 €
IBERDROLA 4.25% 18	900 000	998 568 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
IBERDROLA 4.5% 17	2 200 000	2 450 408 €
IBERDROLA 5.75% 2018	4 800 000	5 313 351 €
IBESM 4.75% 2016	21	2 350 840 €
IBM 5.875% 11/32	1 150	970 267 €
IBM 6.22% 08/2027	2 625	2 307 540 €
IBM 6.50 01/28	1 285	1 160 086 €
IBM 7,625%1018	8 450	7 747 987 €
IBM CORP 1.875% 20	11 000 000	10 880 894 €
ICADE 2.25% 19	20 200 000	20 334 150 €
IFIL INV.5,375%17	20	1 137 890 €
IMERYS 2.5% 13-2020	3 100 000	3 072 683 €
IMP TOBAC 2.05% 18	2 225 000	1 605 373 €
INBEV NV 4% 0418	2 000	2 263 990 €
INBEV NV 8.625%01-17	4 600	6 002 166 €
ING 3% 01/09/15	720	544 401 €
ING 4%11-23/12/16	3 795 000	4 107 307 €
ING BANK 1.875% 2018	13 230 000	13 575 419 €
ING BANK 3.875%11-16	6 160	6 709 529 €
ING BANK 4.25% 2017	180 000	203 383 €
ING BANK 4.5% 2022	5 300 000	6 202 530 €
ING BANK NV 0316	4 000 000	2 922 840 €
ING BANK NV 3.50% 23	12 043 000	12 128 517 €
ING BANK NV 3.75% 17	4 000 000	3 099 748 €
ING BANK NV 5.8% 23	3 850 000	2 945 163 €
ING BANK TV19	1 000	1 035 294 €
ING BANK TV290523	2 900	3 328 862 €
ING BK NV 2.375% 14	5 535	4 057 037 €
ING GROEP 4,75%17	3 000	3 400 560 €
ING US INC 2.9% 2018	6 200 000	4 650 825 €
ING US INC 5.5% 2022	9 090 000	7 294 331 €
ING US INC 5.7% 2043	1 835 000	1 434 312 €
INLT GAME 7.50% 19	6 200	5 281 699 €
INT PAPER 7.5% 21	2 500	2 279 547 €
INT PAPER 7.95%08-18	2 335	2 078 500 €
INT.LEASE 6.50%14	322	246 553 €
INTEL CORP 2.7% 22	6 000 000	4 007 990 €
INTERCONTI 4% 23	3 110 000	2 277 705 €
INTESA 3.75%11-16	146	7 674 859 €
INTESA 3.875% 2019	2 210 000	1 611 129 €
INTESA 4%10-2018	50	5 311 079 €
INTESA 5% 0217	2 100 000	2 365 544 €
INTESA 5%23/09/2009	20	1 059 554 €
INTESA SA 4.125% 16	130	14 134 717 €
INTESA SA 4.375%2019	8 800 000	9 450 924 €
INTESA SAN 3.125% 16	1 475 000	1 105 831 €
INTESA SAN 3.875% 18	4 680 000	3 508 110 €
INTESA SAN 4% 17	7 322 000	7 757 338 €
INTESA SAN 4% 23	11 671 000	11 852 275 €
INTESA SANP 3.375%25	1 500 000	1 541 738 €
INTESA SANP 4.875%15	6 300 000	6 769 042 €
INTESA SANP TV 2015	2 800 000	2 817 870 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
INTESA SP 3.625%22	3 500 000	3 669 848 €
INTESA SPA 6.625% 23	5 293 000	5 813 108 €
INTNED 2.125% 2015	670 000	689 966 €
INTP 7.3% 15/11/2039	965	859 194 €
INTPUBLICGRP 3.75 23	2 875 000	1 975 376 €
INVESTOR 4.875%21	2 000	2 352 049 €
IP 9.375%15/05/2019	1 430	1 374 011 €
ISPIM 4.125%12-2016	3 100 000	3 308 408 €
ITALIE 4,25%19	8 500	9 253 502 €
ITALIE 4.5% 01/03/24	13 000 000	13 674 665 €
ITC HOLDGS 4.05% 23	5 500 000	3 903 338 €
J P MORGAN 5,25%15	9 000	6 946 827 €
JCDECAUX 2% 18	3 600 000	3 695 730 €
JEFFERIES 5.125%2023	2 105 000	1 575 354 €
JEFFERIES 6.50%2043	3 010 000	2 216 251 €
JEFFERIES8.50% 2019	4 000	3 633 805 €
JERSEY 4,7% 04 2024	1 890 000	1 388 133 €
JOHN DEERE 2.25%19	1 200 000	872 987 €
JOHNSON 4,75%19	100	5 925 092 €
JP MORGAN 3.875%2020	20	1 105 557 €
JP MORGAN 4 3/8%21	136	7 132 879 €
JP MORGAN 4,375%19	39	1 994 387 €
JP MORGAN 4.5%12-22	13 040 000	10 171 465 €
JP MORGAN 6%011017	7 625	6 402 772 €
JP MORGAN TV 18	36	1 772 320 €
JPM 4.625% 2021	6 700	5 244 830 €
JPM 7.9% 2018	3 955	3 202 759 €
JPM CHASE 6 07/17	9 300	7 653 799 €
JPMORG CHASE 4.4%20	8 430 000	6 669 999 €
JPMORGAN 2.625% 21	24 426 000	24 769 279 €
JPMORGAN 2.75% 0822	2 800 000	2 846 007 €
JPMORGAN 2.75% 23	1 900 000	1 957 040 €
JPMORGAN 3.20%2023	2 250 000	1 565 906 €
JPMORGAN 3.25% 22	12 390 000	8 652 756 €
JPMORGAN 3.375% 2023	4 090 000	2 777 139 €
K FOODS 6.875% 2039	645	586 270 €
KAISER HOSP 3.5% 22	3 050 000	2 110 554 €
KANSAS CITY 2.35% 20	920 000	627 581 €
KANSAS CITY 3% 05/23	1 885 000	1 251 578 €
KANSAS CITY 4.3% 43	3 875 000	2 421 859 €
KBC 5%11-2016 EMTN	144	8 107 761 €
KBC IFIMA 2.125% 18	13 670 000	13 949 550 €
KBC IFIMA 3% 08/16	4 505 000	4 763 744 €
KBC IFIMA 3.875 15	2 954	3 153 904 €
KBC IFIMA 4.37 15	2 500	2 673 650 €
KENT UTILI 5.125%40	2 505	1 941 250 €
KERING 2.5%13-2020	3 700 000	3 750 047 €
KERRY GROUP 3.2% 23	1 599 000	1 069 067 €
KEY BANK 1.65% 18	2 998 000	2 152 503 €
KEYCORP 5.10% 21	2 000	1 601 713 €
KIMCO RLTY 3.125% 23	3 500 000	2 290 477 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
KINDER 5% 0842	4 875 000	3 296 289 €
KINDER MORG 3.5% 23	4 940 000	3 333 210 €
KINDER MORG 3.95%22	4 000 000	2 853 836 €
KINDER MORG 5% 43	1 000 000	675 231 €
KINDER MORG 6.85% 20	3 000	2 629 935 €
KINDER MORGA 3.5% 16	1 555	1 195 883 €
KINDR MORG 9% 19	620 000	586 554 €
KKR 5.5% 01/02/2043	7 816 000	5 429 454 €
KLEPIERRE 4% 10-2017	3 200 000	3 552 320 €
KLEPIERRE 4,25%16	1 200 000	1 321 987 €
KMP 2.65% 2019	985 000	715 682 €
KMP 5.625%15/02/2015	5 700	4 431 808 €
KMP 6.5%01/09/2039	3 110	2 506 981 €
KOHL'S 4.75% 23	4 000 000	2 938 155 €
KON.PHILIP.5,75%18	1 900	1 607 820 €
KONINK 1.75% 19	6 123 000	6 088 093 €
KOREA GAS 2.875%2018	2 100 000	1 552 723 €
KPN 3.25% 2021	4 010 000	4 183 573 €
KPN 3.75 21/09/20	10 200	10 859 156 €
KPN 7.50% 04/02/19	3 000	3 931 743 €
KRAFT 6,25%15	1 772	1 971 155 €
KRAFT 6,50%31	4 500	3 735 748 €
KRAFT 6,875%38 SR	3 035	2 760 730 €
KRAFT FDS 5.375% 24	181 000	151 142 €
KRAFT FDS 6.125% 18	1 500 000	1 289 765 €
KRAFT FOODS 5% 2042	5 575 000	3 974 416 €
KRAFT FOODS 6.875 39	1 856 000	1 687 164 €
KROGER 5% 42	1 265 000	870 407 €
KROGER CO 1.2% 2016	1 250 000	906 981 €
KROGER CO 3.3% 21	5 295 000	3 828 323 €
KROGER CO/THE5.15%43	810 000	584 296 €
LA POSTE 2.75%2024	6 000 000	5 961 354 €
LABORATORY 4% 2023	4 947 000	3 474 110 €
LEASE CORP 2.375% 19	1 780 000	1 794 294 €
LEASEPL C 3.875 15	2 723	2 881 017 €
LEASEPL CO 4.125% 15	1 500 000	1 610 098 €
LEASEPLAN 2.5% 16	600 000	621 381 €
LEASEPLAN 2.50% 2018	18 130 000	12 825 369 €
LEGAL TV25 EMTN	7 925	8 351 943 €
LEGRAND 4.25% 02/17	1 300 000	1 465 769 €
LEGRAND 4.375% 2018	3 100 000	3 558 769 €
LEUCADIA NTL 5.5%23	2 290 000	1 671 085 €
LIBERTY 5%11-2021	1 040	795 711 €
LIBERTY MUT 4.25%23	2 250 000	1 567 748 €
LIBERTY MUT 6.5% 42	1 450 000	1 170 340 €
LIFE TEC 3.50%2016	3 123	2 402 108 €
LINCOLN 4.85% 2021	5 460	4 249 269 €
LINCOLN 6.05/TV 67	1 495	1 084 260 €
LINCOLN 8.75%09-2019	1 834	1 705 604 €
LINDE FIN.TV140766	13 463	15 697 072 €
LLOYD TSB 4.875% 16	7 950	6 330 250 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
LLOYD TSBB 3.75 15	1 900	2 014 725 €
LLOYDS 5.375%09-19	3 000	3 602 993 €
LLOYDS 6.375%062016	6 311	7 337 961 €
LLOYDS BANK 2.30% 18	3 765 000	2 722 641 €
LLOYDS BK 11.875%21	700	875 933 €
LLOYDS BK 4.625% 17	1 750 000	2 002 225 €
LLOYDS TSB 6500 0320	9 284	11 229 441 €
LOEWS 2.625%13-2023	1 270 000	824 628 €
LOEWS CORP 4.12% 43	1 750 000	1 090 138 €
LORILLARD 8.125%19	1 325	1 172 964 €
LORILLARD 2.3% 0817	2 950 000	2 173 342 €
LOTTOMATI5.375%12-16	32	1 765 796 €
LOTTOMATIC 5.37 18	10	585 987 €
LOTTOMATICA 3.5% 20	3 000 000	3 193 795 €
LOWES CO 5% 09/43	1 550 000	1 152 620 €
LUKOIL INT 3.416% 18	2 170 000	1 598 644 €
LUXOTTICA 3.625% 19	3 900 000	4 330 479 €
LUXOTTICA 4%2015	1 000 000	1 060 287 €
LVMH 4 06/04/2018	3 000 000	3 408 321 €
LVMH MOET 1.75% 20	4 000 000	3 919 916 €
LYB INTL FI 5.25% 43	3 580 000	2 657 295 €
LYONDELLBA 5% 19	2 000 000	1 615 850 €
LYONDELLBA 6% 21	7 000 000	5 857 464 €
M&I MARSH 4.85% 0615	7 032	5 373 361 €
MAC BK LTD 6% 20	1 000 000	1 130 389 €
MACK-CALI REA.2.5%17	1 575 000	1 134 092 €
MACQ GROUP 6% 20	6 000 000	4 919 994 €
MACQUARIE 3% 12/18	6 000 000	4 347 006 €
MACQUARIE 6.625%2021	2 700	2 192 584 €
MACQUARIE BK 2.50%18	3 700 000	3 812 422 €
MACQUARIE BK 3.45%15	11 275 000	8 593 086 €
MACYS 5.125% 2042	14 380 000	10 181 463 €
MACYSRETAIL 2.875%23	1 970 000	1 308 587 €
MAGELL MID 6.4 18	1 760	1 553 958 €
MAGELLAN MID 5.15%43	5 000 000	3 624 475 €
MAN SE 7.25% 05/16	900 000	1 077 816 €
MANPWR INC 4.50%2018	600 000	661 633 €
MANULIFE 3.4%10-15	8 404	6 410 341 €
MARATHON 5.125% 21	1 735 000	1 383 196 €
MARATHON O 0.90ù 15	1 800 000	1 309 517 €
MARATHON OIL 2.8% 22	8 865 000	5 932 361 €
MARATHON P 6.50% 41	3 885	3 244 970 €
MARSH 5.75% 0915	131	208 725 €
MARSH COS 4.80% 21	3 560 000	2 795 035 €
MASS MUTL 8.875% 39	1 564	1 634 247 €
MAXIM 2.5% 11/18	6 742 000	4 858 042 €
MCDONALD'S 2.375% 24	2 500 000	2 385 782 €
MCDONALDS 4% 02/21	31	3 564 682 €
MCDONALDS 4.25% 0616	3 000	3 322 056 €
MCKESSON 0.95% 15	2 130 000	1 547 739 €
MCKESSON 7.5%09-2019	190	171 436 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
MDC HLDGS 5.625% 20	6 500	5 056 352 €
MEDIOBANCA 3.75%15	2 363 000	2 463 370 €
MEDIOBCA 4.625% 16	1 000 000	1 073 764 €
MERCIALYS 4.125% 19	4 300 000	4 776 319 €
MERCK FIN 4.5%10-20	3 747	4 398 367 €
MERCK NEW 2.40% 22	300 000	200 464 €
MERCK&CO 5%09-2019	7 100	5 826 356 €
MERR LYNCH 5.7% 2017	1 480	1 200 964 €
MERRILL 4 7/8%14	18	941 433 €
MERRILL L.4 5/8%18	1 600	1 743 720 €
MET LIFE 2.375% 19	4 670 000	4 772 771 €
MET LIFE 2.375% 2023	5 786 000	5 748 013 €
METLIFE 4.368% 23	3 300 000	2 443 130 €
METLIFE 4.125 0842	1 950 000	1 246 159 €
METLIFE 6.50 12/32	2 253	1 949 006 €
METLIFE 6.75%16 SR	1 875	1 552 597 €
METLIFEINC6.4% 1236	6 450	4 795 878 €
MICROSFT CO 2.125 22	1 710 000	1 121 931 €
MICROSOFT 2.125% 21	17 400 000	17 247 311 €
MICROSOFT 2.625% 33	3 507 000	3 243 405 €
MICROSOFT 3.125% 28	10 900 000	10 800 528 €
MIDAM ENER 5.15%43	1 785 000	1 297 609 €
MIDAM NRJ 5.8%06-36	2 055	1 717 939 €
MIDAMER 6.5 09/37	5 170	4 436 924 €
MID-AMER APT 4.3% 23	8 375 000	5 924 348 €
MIDAMER.6 1/8%36	8 238	6 804 156 €
MIZUHO BK 1.55% 17	1 885 000	1 340 816 €
MOHAWK 3.85%2023	1 430 000	996 451 €
MONDELEZ 2.375% 21	4 700 000	4 644 313 €
MONDI 5.75% 2017	3 897 000	4 544 114 €
MONDI FINAN 3.375%20	1 260 000	1 286 052 €
MONSANTO5.875% 04/38	5 000	4 137 161 €
MORG 4.50% 02/2016	6 822	7 550 332 €
MORG 5.375% 08/20	64	3 803 238 €
MORGAN 5,50%021017	4 450	5 118 950 €
MORGAN 5.5%2021	3 000	2 472 804 €
MORGAN 6.375%12-2042	4 550 000	3 934 079 €
MORGAN C&C 3.7 15	2 220	1 687 276 €
MORGAN C&C 4.35 21	1 340	1 038 242 €
MORGAN C&C 5.62% 43	1 775 000	1 371 736 €
MORGAN C&C 6.3% 19	2	1 727 €
MORGAN C&C 6.4% 38	3 680	3 179 737 €
MORGAN ST.4 3/8%16	1 900	2 071 586 €
MORGAN STAN 5.95% 17	3 000 000	2 482 565 €
MORGAN STAN 6%04-14	8 116	6 050 530 €
MORGAN STAN 7.3%19	5 248	4 662 822 €
MORGAN STAN. 2.25%18	8 532 000	8 818 702 €
MORGAN STAN.3.75%23	12 355 000	8 827 076 €
MORGAN STAN.LIBUS 15	775 000	562 460 €
MORGAN STANL 3.75%17	11 571 000	12 511 527 €
MORGAN STANL.5%19	3 950 000	4 656 495 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
MORGAN STANLEY 5% 25	5 750 000	4 200 397 €
MORRISON(WM) 2.25% 2	13 500 000	13 403 076 €
MOSAIC 3.75%15/12/21	2 200	1 551 388 €
MOSAIC 4.875% 41	645	424 021 €
MOSAIC 5.625% 2043	6 723 000	4 955 822 €
MOTABILITY 3.75 17	400	435 938 €
MOTOROLA 6% 11/17	2 500	2 071 340 €
MOVIL SAB 5.625 17	2 645	2 180 246 €
MOVIL SAB 6.375 35	1 020	818 980 €
MS 3.8% 2016	3 300	2 542 076 €
MS 5.5%26/01/2020	13 510	11 218 864 €
MTVD 5.75%15/01/2020	6 900	5 789 823 €
MUNC.RUCK.TV PERP.	110	6 103 812 €
MUNICH RE 6% 2041	5	596 223 €
MUNICH RE 6.25% 42	5 400 000	6 543 976 €
MURRAY 4.647%2017	6 300 000	4 946 444 €
MYLAN 5.40% 2043	1 880 000	1 369 784 €
MYLAN INC 2.18% 23	2 250 000	1 644 165 €
MYLAN INC 6% 11/18	4 125 000	3 235 845 €
NAB 4.625%10-20	3 000	3 411 975 €
NASDAQ OMX 5.25% 18	6 900	5 558 567 €
NAT AUS BK 2.75%2022	2 800 000	2 873 211 €
NAT AUS BK 4 20	1 300	1 469 230 €
NAT RURAL 5.45 17	6 250	5 135 530 €
NATGRID US 3.25 15	2 310	2 433 058 €
NATIONAL 5%18 EMTN	1 700	1 989 805 €
NATIONWIDE 3.125%17	2 538 000	2 733 582 €
NATIONWIDE 3.75%2015	3 173	3 383 058 €
NATIONWIDE 5.375%21	7 550	5 933 152 €
NATIXIS TV0519EMTN	4 450 000	4 612 911 €
NATL AUSTR 2% 20	14 076 000	13 863 082 €
NATL BANK CA 2.20%16	5 690 000	4 283 318 €
NATL GRID NA 1.75%18	7 700 000	7 871 113 €
NATWIDE B 4.125%2023	19 395 000	20 768 360 €
NATWIDE BS FRN 20	4 177	5 041 507 €
NBC UNIVER 4.37% 21	1 655	1 281 295 €
NBC UNIVER 5.95% 41	1 600	1 276 414 €
NBCUNIVSAL 4.45%43	1 569 000	1 032 879 €
NBHSS 4.5%03-20	7 477	8 367 288 €
NBL 8.25% 03-19	6 100	5 638 331 €
NCB CLEVE 5.25%2016	3 340 000	2 678 405 €
NCB CLEVE 5.8 17	5 000 000	4 099 544 €
NEMOURS E 3.625% 21	3 000 000	2 253 905 €
NESTLE FI 1.25% 2020	6 389 000	6 231 622 €
NETAPP INC 2% 17	1 325 000	958 451 €
NEW YORK 4,3/8%17	119	6 794 494 €
NEW YORK LIFE	1 353	1 206 636 €
NEWMONT 5 7/8%35	2 300	1 442 801 €
NEWMONT MIN 3.5% 22	8 100 000	5 053 178 €
NEWS 6,15%37 SR	7 000	5 679 374 €
NEWS AMER 4% 23	1 160 000	837 565 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
NEWS AMER 5.40% 2043	875 000	656 171 €
NEWS AMER 6.15 41	2 500	2 047 024 €
NEWS AMER 6.2%04-34	995	794 452 €
NEWS AMER 6.65%2037	4 695	3 983 137 €
NEWS AMER 6.9%09-19	2 750	2 442 086 €
NEXEN 5,875%05-35	1 700	1 331 180 €
NEXTERA ENERGY	3 619 000	2 641 579 €
NGG FINANCE 4.25%76	2 000 000	2 092 386 €
NGGLN 4.375%05-20	888 000	1 034 403 €
NIAGARA 3.553%09-14	2 170	1 616 226 €
NIF 6.125%01/03/2022	3 560	2 917 157 €
NIKE 2.25% 01/05/23	1 660 000	1 082 310 €
NISOURCE 4.45% 2021	2 100 000	1 548 026 €
NISOURCE 6.80% 2019	850 000	739 807 €
NISOURCE FI 5.65% 45	1 125 000	840 249 €
NISOURCE FIN 4.8%44	1 115 000	737 588 €
NOBLE ENERGY 4.15%21	1 085	805 148 €
NOBLE ENERGY 6% 2041	3 040	2 421 947 €
NOBLE HLD 5.25% 42	1 300 000	905 714 €
NOBLE HOL 4.9% 2020	3 000	2 343 190 €
NOMURA EURO 1.875%18	15 000 000	14 850 962 €
NOMURAHLDS 2 %2016	5 500 000	4 043 623 €
NORDDEUT 0.875% 15	4 400 000	3 208 926 €
NORDEA AB 3.625% 16	2 188	2 386 549 €
NORDEA BANK 1.375%18	6 773 000	6 785 012 €
NORDEA BANK 4% 07/19	3 400 000	3 831 924 €
NORDEA BANK 4.25%22	2 000 000	1 446 383 €
NORDEA BK 3.25% 22	6 900 000	7 383 708 €
NORDEA BK 3750 0217	1 900	2 114 578 €
NORDEA BK 4.625% 22	1 650 000	1 833 169 €
NORDSTROM 7%07-2038	1 810	1 691 422 €
NORFOLK 2.903%2023	1 284 000	869 605 €
NORFOLK 7.25% 01-31	3 283	3 008 108 €
NORTHERN 2.375%2022	2 900 000	1 948 192 €
NSTAR ELEC 2.375%22	3 725 000	2 460 040 €
OAT 3% 25/04/22	637 655 461	694 968 633 €
OAT 3,5%AVRIL 2015	396 404 525	423 014 346 €
OAT 3.50% 25/04/20	2 627 329 335	2 994 834 763 €
OAT dem 04/14	7 702 230	7 697 455 €
OAT ZCP 04/24	175 663 400	132 664 513 €
OAT ZCP 25/04/16	7 632 537	7 562 928 €
OAT ZCP 25/04/2015	7 632 537	7 607 655 €
OAT ZCP 25/04/2017	7 632 537	7 456 378 €
OAT ZCP 25/04/2018	7 632 537	7 293 729 €
OAT ZCP 25/04/2019	7 632 537	7 084 597 €
OAT ZCP 25/04/2020	9 223 122	8 308 834 €
OAT ZCP 25/04/2021	7 632 537	6 620 921 €
OAT ZCP 25/04/2022	7 632 537	6 360 804 €
OAT ZCP 25/04/2023	7 632 537	6 031 078 €
OAT3,25%06-16	371 222 619	404 222 276 €
OAT3,75%07-17	452 017 074	509 414 821 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
OAT4%08-18	761 724 614	879 239 523 €
OAT4,25%07-23	930 870 000	1 084 724 194 €
OCC PETRL 4.10% 21	1 550	1 201 127 €
OHIO 6.60%01032033	2 200 000	1 878 385 €
OHIO E 6.875% 07/36	2 105	1 815 803 €
OMAHA 6.95% 2040	7 000	5 962 205 €
OMNICOM 3.625% 05/22	2 975 000	2 112 803 €
OMNICOM 4.45% 2020	5 500	4 290 907 €
OMNICOM 5,9%16 SR	2 140	1 736 112 €
OMV AG 4.25% 10/21	3 000	3 409 211 €
ONCOR 5.3% 06/42	830 000	623 089 €
ONCOR ELEC 4.1% 06/2	2 200 000	1 605 679 €
ONCOR ELEC 7% 09/22	1 635 000	1 443 396 €
ONEOK 8.625% 03/19	2 000	1 858 187 €
ONEOK INC 6% 06/2035	2 100	1 420 224 €
ONEOK PART 6.65%36	750	597 229 €
ONEOK PARTN 2% 17	1 050 000	757 836 €
ONEOK PARTN 6.85%37	1 800 000	1 480 147 €
OPER 1.25% 08/15	1 350 000	990 289 €
OPTUS FINAN 3.5% 20	6 000 000	6 508 654 €
ORACLE 3.125% 25	8 000 000	8 221 848 €
ORACLE 2.25%13-2021	6 227 000	6 327 790 €
ORACLE 3.75% 07/14	1 800 000	1 352 883 €
ORACLE 5.375% 2040	2 229 000	1 757 465 €
ORACLE 5.75 04/18	2 920	2 475 605 €
ORACLE CORP 2.5% 22	8 865 000	5 915 565 €
ORANGE 1.875% 18	13 400 000	13 483 767 €
ORANGE 3.125% 24	6 100 000	6 108 187 €
ORIG ENER 2.875%19	10 100 000	10 312 027 €
ORIGIN ENER 2.50%20	6 400 000	6 293 549 €
ORIGIN ENER 3.5% 21	2 730 000	2 824 577 €
PAC LIFE 9.25%39	1 567	1 583 144 €
PAC.GAS 6,25%39 SR	3 000	2 516 180 €
PACCAR FIN 1.375% 15	580 000	590 188 €
PACIFIC GAS 3.85%23	2 075 000	1 497 489 €
PACIFIC LIF.5.125%43	2 150 000	1 455 612 €
PACKAGG CORP 4.5% 23	4 225 000	3 087 325 €
PACKAGING 3.90%2022	800 000	561 652 €
PASO NATGAS 5.95% 17	3 790	3 082 191 €
PASO NATL 8.625% 22	875	822 235 €
PEMEX 6 3/8%16REGS	11 235	12 926 174 €
PEMEX PRO 6.625% 35	305 000	231 822 €
PENSKE TR 3.375% 18	11 750 000	8 786 758 €
PENSKE TRUCK 3.75%17	2 500 000	1 911 349 €
PENTAIR FCE 5% 2021	1 360 000	1 036 027 €
PENTAIRFI 1.875 0917	2 937 000	2 117 929 €
PEOPLE'S UNT 3.65%22	7 829 000	5 354 400 €
PERKINELMR 5%21	1 750	1 306 402 €
PERNOD RI 4.875 16	1 200 000	1 340 565 €
PERNOD RIC 5% 2017	4 700 000	5 388 620 €
PERRIGO CO 4% 23	2 100 000	1 477 185 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
PETRO MEX 4.875 0122	2 405 000	1 826 689 €
PETROBRGL 4.37% 2023	5 030 000	3 262 985 €
PETROHAWK 7.875%15	2 524	1 888 368 €
PETROL MEX TV 18	3 000 000	2 250 872 €
PETROL MEXI 4.875%24	2 210 000	1 634 540 €
PETROLE MEX 3.125%20	14 073 000	14 261 784 €
PFIZER 5.75%03/06/21	125	7 913 406 €
PFIZER 7.20% 03/39	1 980	1 953 057 €
PFIZER INC	2 700	2 101 422 €
PGNIG FINANCE 4%2017	4 400 000	4 843 195 €
PHILIP 2.125%2019	12 240 000	12 532 125 €
PHILIP 3.6% 11/23	1 575 000	1 112 936 €
PHILIP IN 6.375%2038	2 340 000	2 016 289 €
PHILIP INT 1.75%2020	13 750 000	13 633 784 €
PHILIP INT 4.37% 41	1 730 000	1 148 635 €
PHILIP MOR 1.875%19	3 950 000	2 815 375 €
PHILIP MOR 3.125%33	4 280 000	4 137 514 €
PHILIP MOR 4.125%43	2 710 000	1 740 995 €
PHILIPPS 66 4.3% 22	6 250 000	4 643 829 €
PIEDMONT 3.4% 2023	2 305 000	1 495 675 €
PIONEER N 6.875% 18	2 280 000	1 954 395 €
PIONEER N 7.5% 2020	320 000	290 540 €
PKO FINAN 3.733% 15	1 000 000	1 048 495 €
PL 7.375%15/10/2019	5 500	4 892 456 €
PLAINS 2.85%12-2023	1 910 000	1 265 238 €
PLAINS ALL 4.30% 43	2 135 000	1 356 836 €
PLAINS EXP 6.50% 20	950 000	765 080 €
PLAINS EXP 6.87% 23	3 000 000	2 481 357 €
PLAINS EXPL 7.625%20	4 467 000	3 647 455 €
PLAINS PIPEL 3.65%22	5 600 000	3 980 266 €
PLUM CREE 4.70% 21	1 760	1 333 101 €
PNC BANK NA 3.80%23	1 670 000	1 187 052 €
PNC PFD TV 06-2049	55	3 434 902 €
POHJOLA BANK 1.75%18	5 541 000	5 579 748 €
POHJOLA BK 1.25% 18	1 300 000	1 293 313 €
POHJOLA BK 5.75% 22	3 817 000	4 643 001 €
POST HOMES 3.75% 22	7 750 000	5 153 906 €
POSTE ITAL 3.25%18	2 244 000	2 353 858 €
PPL CAPITAL 3.5%22	8 250 000	5 655 030 €
PPL ELEC 3% 2021	1 050	751 475 €
PPL ELECTRIC 4.75%19	5 030 000	3 735 321 €
PPL ENERGY 4.60% 21	5 800 000	4 044 187 €
PPL ENERGY 6.5% 2018	2 500	2 039 292 €
PPR 3.125% 23/04/19	10 535 000	11 332 489 €
PPR 3.75% 04/2015	4 347 000	4 626 894 €
PRECIS CAST 3.9% 43	2 050 000	1 312 073 €
PRICOA GLO 5.45 14	2 125	1 581 366 €
PRICOA GLOB 1.6% 18	3 250 000	2 287 747 €
PRIDE INT 6.875% 20	4 400 000	3 894 273 €
PROCTER & GAMBLE	2 000	2 300 981 €
PROCTER 4 7/8%27	5 570	6 809 575 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
Procter&G 2% 0822	6 000	5 842 234 €
PROCTER&GAMBLE 2%21	8 020 000	7 889 493 €
PROG EN 3.15% 04/22	2 665 000	1 863 725 €
PROG ENER 3%11-2021	3 000	2 150 425 €
PROGRE 6.7% 2037	1 500	1 179 271 €
PROGRS NR 4.875% 19	1 965	1 572 142 €
PROLOGIS 2.75% 18	4 445 000	4 482 430 €
PROLOGIS 3% 01/22	8 931 000	8 816 724 €
PROLOGIS 4.25%2023	1 750 000	1 270 145 €
PROSEGUR 2.75% 02/18	15 400 000	15 936 236 €
PROTC LIFE 8.45% 39	500	469 966 €
PRU FI4.75%17/09/15	7 415	5 808 454 €
PRUD 4.50% 2021	2 500	1 931 998 €
PRUDENT 7.575% 2019	1 825	1 626 530 €
PRUDENT 8.875% 68	2 920	2 577 261 €
PRUDENT FI 4.5% 2020	5 350	4 191 027 €
PRUDENT FI 5.4% 2035	1 150 000	861 519 €
PRUDENT FI 5.7% 36	696	541 537 €
PRUDENT FI 5.80% 41	4 575 000	3 644 878 €
PRUDENTIAL 2.30%18	1 325 000	968 069 €
PS COLOR 2.25%2022	1 725 000	1 137 052 €
PS COLOR 3.20% 20	1 690	1 212 318 €
PSEG POWER 4.3% 23	3 449 000	2 503 955 €
PUB SVC EL 3.75% 24	3 450 000	2 530 714 €
PUBLIC SERV 4.75% 41	4 405	3 257 488 €
PX 4.5%15/08/2019	4 700	3 822 165 €
QBE INSUR 2.4% 18	5 250 000	3 695 587 €
QUEBEC 2.625% 23	1 805 000	1 211 870 €
QVC 7.5% 01/10/19	2 175 000	1 739 955 €
QVC INC 4.375% 2023	4 000 000	2 757 064 €
QVC INC 7.375%2020	800 000	635 950 €
QWEST CORP 6.5% 2017	3 010	2 476 876 €
QWEST CORP 7.5 %14	1 061	819 949 €
R.BOSCH 2.625% 28	1 300 000	1 263 776 €
RABOBANK 1.70%2018	3 925 000	2 822 083 €
RABOBANK 3.375% 17	5 000 000	5 472 155 €
RABOBANK 3.5% 10/18	14 900	16 250 195 €
RABOBANK 3.75% 2020	15 047	15 588 074 €
RABOBANK 3.875% 16	2 860	3 128 637 €
RABOBANK 3.875% 2023	5 000 000	5 095 236 €
RABOBANK 3.95% 22	6 420 000	4 511 119 €
RABOBANK 4% 01/22	3 445 000	3 911 116 €
RABOBANK 4,75%0118	8 000	9 391 510 €
RABOBANK 4.125% 2021	2 827	3 239 521 €
RABOBANK 4.125%2020	8 227	9 428 437 €
RABOBANK 4.2%09-14	3 920	2 900 764 €
RABOBANK 4.375%09-16	4 871	5 398 073 €
RABOBANK 4.625% 23	1 850 000	1 347 004 €
RABOBANK NL 3.875%22	7 795 000	5 758 595 €
RABOBANK TF11%/TV 49	1 160	1 114 770 €
RABOBK 5 7/8% 05/19	11 850	14 077 225 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
RABOBK NL 4.125% 22	2 200 000	2 303 122 €
RAFFEIS BK 1.875% 18	6 600 000	6 518 957 €
RAIFFEISEN BANK INTL	500 000	500 609 €
RAIFFEISEN BK 6%2023	2 700 000	2 799 926 €
RB SCOTLD 10.50% 22	3 000 000	3 898 952 €
RBS 2.55%12-2015	3 000 000	2 241 803 €
RBS 4.375% 2016	7 000	5 482 180 €
RBS 4.875% 01/2017	9 650	11 094 317 €
RBS 5.625%10-2020	2 890 000	2 384 287 €
RBS GRP PLC 5.375%19	13 270	15 499 380 €
RCI 1.75% 06/07/16	3 500 000	3 565 731 €
RCI 2.875% 2018	7 300 000	7 696 919 €
RCI 4.25% 27/04/17	3 400 000	3 767 660 €
RCI 5.625 10/15	3 637 000	3 960 992 €
RCI BANQUE 3.5% 18	4 250 000	3 173 702 €
REALTY INC 3.25%2022	3 400 000	2 255 396 €
REALTY INCO 4.65%23	1 250 000	930 309 €
REALTY INCOME	7 000	5 714 825 €
REALTY INCOME 2%2018	3 600 000	2 582 225 €
RED ELE FIN 3.875%22	4 000 000	4 370 252 €
RED ELEC 2.375% 19	1 500 000	1 522 448 €
RED ELEC 3.50% 10/16	34	1 808 215 €
RED ELECT 4.75% 18	42	4 860 216 €
REINSUR GRP 4.7% 23	4 000 000	2 972 833 €
RELIANCE 5.4% 0222	3 340 000	2 491 317 €
RELIANCE ST 4.5%23	4 704 000	3 358 944 €
RENTK INIT 3.25% 21	2 140 000	2 146 362 €
RENTK INIT 3.37% 19	2 100 000	2 188 907 €
REPSOL 2.625% 2020	9 100 000	9 113 538 €
REPSOL BV 4.87% 19	2 500 000	2 891 183 €
REPSOL FI 3.625% 21	3 000 000	3 121 343 €
REPSOL INT.4,75%17	3 800	4 322 631 €
REPSOL INTL 4.375%18	2 000 000	2 260 932 €
REPU SVCS 5.25% 21	740	587 761 €
REPUBLIC SV 6.2%40	3 450	2 889 617 €
RETAIL OPPOR 2% 23	1 525 000	1 099 784 €
REYNOLDS A 4.75% 42	4 100 000	2 660 362 €
REYNOLDS AME 3.25%22	1 795 000	1 204 741 €
RIO 7,125%0728 SR	1 430	1 318 968 €
RIO TINTO 1625 0817	4 500 000	3 266 799 €
RIO TINTO 2% 20	4 000 000	4 006 243 €
RIO TINTO 2875 0822	1 375 000	938 043 €
RIO TINTO 3.5%12-22	3 530 000	2 523 009 €
RIO TINTO 3.5%20	7 000	5 183 740 €
RIO TINTO FI 2.25%18	5 630 000	4 060 820 €
RIO TNNT0 9% 2019	4 840	4 644 805 €
RIOTIN FIN 8.95% 14	1 600	1 210 294 €
ROCHE 5.625% 03-16	5 000	5 757 579 €
ROCHE 6.5% 03-21	920	1 230 987 €
ROCHE HLDG 7%09-39	1 775	1 696 157 €
ROLLS-ROYC 2.125%21	3 970 000	3 951 620 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
ROPER IND 3.125% 22	10 472 000	6 962 387 €
ROWAN COS 5.4% 42	2 260 000	1 504 715 €
ROWAN COS INC	3 725 000	2 747 102 €
ROYAL BK 4,35%17	20	1 086 414 €
ROYAL BK SC 6.934%18	3 100	3 675 833 €
ROYAL BK SCOT.1.5%16	19 196 000	19 302 206 €
RTE 3.875 06/22	300 000	333 742 €
RWE 4.625% 20	4 100	4 247 687 €
RWE 5% 10-15	500	545 973 €
RWE 6.5%08-21	4 570	5 880 056 €
RYDER SYS 3.15% 2015	7 000	5 260 173 €
RYDER SYS 7.2% 15	2 500	2 036 269 €
RYDER SYSTEM 2.35%19	3 300 000	2 360 548 €
SABMILLER 1.85%2015	1 800 000	1 331 597 €
SABMILLER 1.875% 20	8 300 000	8 328 686 €
SAMBILLER 4.5% 01/15	3 543	3 834 284 €
SAMPO OYJ 4.25% 17	2 325 000	2 591 318 €
SAMSNG 1.75% 2017	4 100 000	2 976 764 €
SAN DIEGO 4.5%0840	670	479 287 €
SANOFI 1.25% 18	2 865 000	2 031 233 €
SANOFI 2.5% 23	5 000 000	4 943 051 €
SANPAOLO 5.35% 18	14 200 000	15 160 819 €
SANT INTL 3.50% 14	198	10 183 297 €
SANTAN CONS 1.625%15	7 500 000	7 562 843 €
SANTAN US 3.724% 15	5 700 000	4 252 193 €
SANTAND INT 4.375%14	4 500 000	4 664 759 €
SANTANDE HLD 3.45%18	2 840 000	2 131 726 €
SANTANDER 3% 2015	5 500 000	4 141 785 €
SANTANDER 3.381% 15	25	2 603 012 €
SANTANDER 3.875%2022	2 275 000	1 588 917 €
SANTANDER 4%27/03/17	4 700 000	5 171 189 €
SANTANDER 4.375%15	100	10 749 295 €
SANTANDER 4.625% 16	13 500 000	14 904 044 €
SANTANDER 5% 11/23	5 740 000	4 212 476 €
SANTANDER INTL 4%20	8 600 000	9 525 682 €
SANTOS 8.25% 2070	2 889 000	3 317 085 €
SAPRR 5% 01/2017	1 300 000	1 495 102 €
SBAB BANK 1.375%2018	8 800 000	8 724 732 €
SBAB BK 2.375% 20	11 900 000	11 972 929 €
SCHLMB NOR 4.20% 21	2 303	1 775 210 €
SCHLUMB FI 2.75% 15	3 000	3 120 667 €
SCHNEIDER 3.75% 18	4 500 000	4 994 900 €
SCHNEIDER EL 2.5%21	5 200 000	5 250 784 €
SCOR 6,154%06PERP.	4 450 000	4 815 940 €
SCOTTISH & SOUTH	9 421	9 879 559 €
SEAGATE 3.75% 11/18	2 250 000	1 663 707 €
SEB 2% 18/03/19	3 600 000	3 638 439 €
SEB 3.75% 2016	1 921	2 088 906 €
SEB AB 4.25 02/18	5 594	6 389 209 €
SECURIT AB 2.25% 18	600 000	615 528 €
SECURIT AB 2.62% 21	1 900 000	1 865 147 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
SECURIT AB 2.75% 17	2 600 000	2 749 622 €
SEMPRA 9.8% 15/02/19	815	802 327 €
SEMPRA ENERGY 6%39	7 100	5 767 288 €
SES 4.75%11-2021	1 500	1 753 202 €
SES SA 3.6% 23	2 404 000	1 643 370 €
SEGLX 4.625%03-20	12 540	14 536 291 €
SEVERN 5,25%110316	2 148	2 431 825 €
SG 3.125 21/09/17	125	6 710 193 €
SHBASS 3.125% 2016	7 400	5 698 973 €
SHELL 6.375%12-38	1 160	1 033 080 €
SHELL INT 2.375% 22	3 085 000	2 060 867 €
SHELL INT 4.375 20	3 050	2 429 650 €
SIAS 4.25% 10/20	1 700	1 901 155 €
SIEMENS F 6.125% 26	945	804 618 €
SIEMENS FI 5.125%17	5 000	5 853 808 €
SIEMENS TV140966	9 000	9 826 445 €
SIMON PROP 5.65%20	3 025	2 545 853 €
SIMON PRO 10.35% 19	805 000	802 548 €
SIMON PROP 1.50%2018	1 675 000	1 180 424 €
SIMON PROP 2.375%20	19 108 000	19 185 895 €
SIMON PROP 4.75%42	3 000 000	2 126 357 €
SKAND 2.375% 11/18	2 675 000	1 930 595 €
SKAND ENSK 4% 09/22	6 630 000	7 084 966 €
SKANDI ENSK 3.875%17	730 000	811 102 €
SKANDINAV 1.875%2019	4 170 000	4 143 865 €
SKANDINAV 2.5%2015	1 700	1 764 989 €
SKF 2.375% 2020	5 100 000	5 066 594 €
SMITHS GR 4.125% 17	3 700	4 066 564 €
SNAM 2.375% 17	7 140 000	7 422 194 €
SNAM 3.375% 21	2 000 000	2 121 496 €
SNAM 3.50% 2020	6 450 000	6 987 712 €
SNAM 3.875% 18	5 705 000	6 342 968 €
SNAM SPA 5% 01/19	11 586 000	13 695 882 €
SNAP ON 4.25% 2018	2 400	1 898 816 €
SOC GE 3.75% 0317	5 000 000	5 554 760 €
SOC GEN 2.375% 02/18	2 300 000	2 429 976 €
SOC GEN 2.75% 17	6 375 000	4 786 532 €
SOC GEN 4% 23	16 900 000	17 290 432 €
SOC GENERALE 2.25%20	7 500 000	7 735 215 €
SOCGEN 4% 2016	1 100 000	1 207 253 €
SOCGEN 5.2% 2021	3 750	3 017 418 €
SOLVAY 6,375%2104	900 000	1 011 857 €
SOLVAY FI 4.199% 49	11 436 000	11 778 248 €
SONOCO 4.375%11-2021	800	593 848 €
SOUTHE COPP 5.25% 42	5 725 000	3 393 777 €
SOUTHERN 5.25% 43	3 245 000	2 382 826 €
SOUTHERN 2.375%10-15	8 970	6 716 420 €
SOUTHERN 4.5% 09/40	1 535	1 078 293 €
SOUTHERN 6.75%042040	1 195	846 812 €
SOUTHERN CAL ED	2 065	1 679 618 €
SOUTHW AIR 5.75% 16	2 000	1 613 447 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
SOUTHWEST 6.45% 0119	4 000 000	3 429 240 €
SPAREBANK 1 2.125%18	2 800 000	2 876 305 €
SPAREBANK 2.125%2020	2 320 000	2 327 945 €
SPAREBANK1 SR 2% 18	1 920 000	1 959 891 €
SPAREBANK3.625%03/15	2 000	2 126 225 €
SPECTRA EC 5.65% 20	2 650	2 114 746 €
SPECTRA PART 4.75%24	1 160 000	874 278 €
SPI ELECT 2.375% 20	5 200 000	5 209 887 €
SSE PLC 2% 170620	15 460 000	15 386 152 €
SSE PLC 2.375% 22	2 000 000	1 982 474 €
SSELN 5.625%12-2049	10 140 000	11 004 624 €
ST CHART 3.625% 15	5 000	5 274 275 €
ST GOBAIN 3.625%2021	6 160 000	6 614 421 €
ST JUDE 3.25% 2023	1 825 000	1 242 113 €
STANDARD 1,625% 18	12 000 000	11 809 710 €
STANDARD 5,875%17	120	6 870 887 €
STANDARD C 3.625% 22	2 100 000	2 049 243 €
STANDARD CH 3.95% 33	5 840 000	3 999 043 €
STANDARD CHART 4% 25	9 302 000	9 318 728 €
STANLEY BLACK 2.9%22	1 350 000	914 790 €
STARBUCKS 3.85%23	8 000 000	5 854 726 €
STATE 3.7% 11/2023	2 125 000	1 532 672 €
STATKRAFT 2.5% 22	6 744 000	6 623 088 €
STATOIL 2.875% 25	8 500 000	8 550 103 €
STATOIL 3.125% 2017	3 900	3 006 122 €
STATSTREET 4.95% 18	3 315	2 647 046 €
STE FONCIERE 3.50%17	1 600 000	1 694 144 €
STEELRIVTC 4.71 17	500	294 609 €
STGOBAIN 3.50 15	3 197	3 367 327 €
STGOBAIN 3.625 %22	950 000	1 019 194 €
STGOBAIN 4% 10/18	650	715 639 €
STGOBAIN 4.50 19	9 423	10 619 271 €
SUEZ 4.078% 2021	2 300 000	2 603 908 €
SUEZ EN 4.82%10-49	18 400 000	19 246 213 €
SUEZ ENV 6.25% 04/19	2 700 000	3 410 955 €
SUMITOMO 1.8% 2018	8 100 000	5 775 637 €
SUMITOMO 2.25%20	13 089 000	12 982 776 €
SUMITOMO 2.75% 2023	9 571 000	9 522 923 €
SUMITOMO MIT 1.45%16	2 825 000	2 074 427 €
SUNCOR 6.85% 2039	1 540	1 345 362 €
SUNCOR ENG 5.95 34	6 900	5 413 261 €
SUNCOR ENG 6.1 18	1 500	1 263 793 €
SUNTRUST 3.50% 2017	7 500	5 799 417 €
SUNTRUST BK 3.6% 16	4 500	3 456 466 €
SUNTRUST BKS 2.35%18	1 475 000	1 065 154 €
SVB FINANC. 5.375%20	7 000	5 634 763 €
SVENSKA 2.25% 2020	5 370 000	5 427 658 €
SVENSKA 3.375% 2017	5 000 000	5 439 733 €
SVENSKA 3.75% 02/17	8 100	9 005 303 €
SVENSKA 4.194% 12/49	1 000	1 024 373 €
SVENSKA CEL 2.5% 23	1 000 000	980 884 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
SVENSKA CEL 3.625%16	2 000 000	2 167 138 €
SVENSKA HAND 2.25%18	7 020 000	7 307 249 €
SVK HANDBK 2.62%2022	5 000 000	5 091 554 €
SVK HANDBK 4.37 21	2 500	2 872 948 €
SWE MATCH 3.875% 17	4 500	4 882 478 €
SWEDBANK 3.375%2017	5 715 000	6 262 532 €
SWEDBANK AB 3% 22	5 000 000	5 087 051 €
SWEDBK HYPO 2.375%17	1 565 000	1 180 540 €
SWISS TRES 2.875%22	1 980 000	1 334 551 €
SWISS TRES 4.25% 42	3 440 000	2 180 818 €
SYDBANK AS 1.50% 16	7 400 000	7 384 747 €
SYMANTEC 2.75% 17	4 254 000	3 149 220 €
TALANX 8.3673% 42	600 000	776 793 €
TALANX AG 3.125% 23	12 100 000	12 651 114 €
TAMPA ELECTR 4.1%42	1 000 000	650 048 €
TARGET 4% 01/07/2042	7 900 000	4 929 749 €
T-BOND 2.875% 2043	1 131 000	664 782 €
T-BOND 3.625% 2043	27 817 000	19 248 788 €
TCM SUB 3.55% 2015	755	572 966 €
TDC AS 3.50% 02/2015	1 855	1 967 816 €
TEACHERS INS6.85%39	773	1 374 049 €
TECK RES 3% 0319	1 850 000	1 344 095 €
TECK RES. 3.75%2023	12 025 000	8 241 439 €
TEL.MEXICO 5,5%15	1 950	1 514 108 €
TELEF SAU 2.736% 19	3 000 000	3 094 683 €
TELEF SAU 3.661 17	154	8 289 844 €
TELEF SAU 5.134% 20	3 950 000	3 077 354 €
TELEF SAU 7.045% 36	859	687 569 €
TELEF.EM.4,375%16	18 775	20 707 205 €
TELEFO MOV 2.875% 15	909	675 725 €
TELEFON EM 3.987%23	3 200 000	3 448 422 €
TELEFONICA 5.811%17	12 500 000	14 488 278 €
TELEFONICA 3.961%21	3 000 000	3 262 795 €
TELEFONICA 4,6911/09	29	1 619 143 €
TELEFONICA 4.71%20	12 900 000	14 842 913 €
TELEFONICA 4.75% 17	40	4 543 222 €
TELEFONICA 4.797%18	400 000	459 766 €
TELEFONICA 4.967%16	5	560 140 €
TELEFONICA 5.431% 02	9	474 153 €
TELEFONICA6,221%17	2 645	2 174 506 €
TELEKFIMA 3.125% 21	9 361 000	9 376 735 €
TELENOR 4.125%10-20	9 000	10 315 547 €
TELIASONERA 3.625%24	2 850 000	3 122 365 €
TELSTRA 2.5% 2023	6 901 000	6 757 181 €
TELSTRA 3.625%10-21	2 000	2 223 213 €
TELSTRA 3.75% 2022	1 000	1 109 154 €
TELSTRA 4.25% 2020	1 000	1 154 011 €
TENNET HOLDING	15 390 000	15 267 380 €
TERNA 4.75% 03/21	5 200	6 093 936 €
TERNA SPA 2.875% 18	2 700 000	2 881 684 €
TESCO 5,125%47	1 000	1 136 061 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
TESCO 5.5 %15/11/17	480	388 237 €
TESCO CORP 2.125%20	6 943 000	6 825 122 €
TESLTRA CO 3.50% 22	10 655 000	11 428 236 €
TEVA PFIN 6.15 36	3 925	3 195 288 €
TEVA PHA 2.875%2019	2 900 000	3 060 028 €
TEVA PHA FIN 2.25%20	950 000	657 064 €
TEVA PHA FIN 3.65%21	3 500 000	2 490 611 €
THALES 2.25% 03/21	2 300 000	2 296 205 €
THERMO FISH 3.2%2016	9 500	7 280 928 €
TIME WAR. 6 5/8%29	3 055	2 533 030 €
TIME WARN 6.75%2018	4 130	3 371 042 €
TIME WARNER 6.10% 40	7 750	6 224 382 €
TIME WARNER INC	5 250	4 229 554 €
TIME WARNER7,57%24	1 012	922 943 €
T-NOTE 0.875% 2016	2 000 000	1 463 927 €
T-NOTE 1.375 18	140 000	10 068 668 €
T-NOTE 2.5% 08/23	3 040 000	2 135 197 €
TOBACC FIN 4.50 18	8 960	10 145 661 €
TOBACCO 6.875%2020	2 000 000	1 688 095 €
TOBACCO 8.375% 02/16	6 099	7 465 621 €
TOBACCO FIN 5%2019	1 500 000	1 723 682 €
TORONTO BK 1.50%2017	8 530 000	6 285 347 €
TORONTO DOM 1.4% 18	3 525 000	2 497 090 €
TOTAL CAP 1.625%14	870	636 410 €
TOTAL CAP 1.875% 20	8 500 000	8 453 403 €
TOTAL CAP 2.3% 2016	1 125	846 915 €
TOTAL CAP CA 2.75%23	2 500 000	1 682 601 €
TOTALCAPI 2.125% 23	3 500 000	3 428 919 €
TOYOTA MTR 1.80%2020	276 000	273 432 €
TRANS 5.05% 15/12/16	3 720	2 974 504 €
TRANS 6.375% 151221	3 000	2 446 938 €
TRANSALTA 4.5% 22	3 200 000	2 247 838 €
TRANSCANA 6.35% 2067	1 500	1 123 433 €
TRANSCANA 7.625% 39	1 000 000	986 747 €
TRANSCANAD 7.25% 38	1 500	1 400 006 €
TRANS-CANADA 2.50%22	3 000 000	2 001 315 €
TRANS-CANADA 3.75%23	2 950 000	2 098 293 €
TRANS-CANADA 3.8% 20	6 200	4 697 708 €
TRANSOCEA 6.50% 20	1 350 000	1 122 774 €
TRANSOCEAN 3.8% 22	4 300 000	2 981 820 €
TRANSOCEAN 7.5% 2031	620 000	516 111 €
TRINITY ACQ 4.625%23	1 945 000	1 412 521 €
TRINITY ACQ 6.125%43	3 000 000	2 213 520 €
TRW AUTO 4,45% 2023	4 155 000	2 956 845 €
TUPPERWARE 4.75%21	2 725 000	2 004 559 €
TVO 4.625%04/ 02/19	3 219 000	3 686 545 €
TVO 6%09-27/06/16	1 152 000	1 316 409 €
TWARN CABL 5.87 40	2 000	1 257 004 €
TWARN CABL 7.5% 2014	4 945	3 714 337 €
TWAT UTIL 3.25% 2016	1 666	1 771 565 €
TYCO ELEC 3.5% 02/22	1 550 000	1 080 686 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
TYCOELECT 7.125% 37	2 300	1 967 765 €
TYSON FOODS 4.5%22	5 573 000	4 109 132 €
UBI SPCA 4.939% 2014	2 000	2 087 133 €
UBIIM 2.75% 13-2017	8 844 000	8 946 802 €
UBS 2.25%12-30/03/17	1 010 000	759 571 €
UBS 6%18 EMTN	6 000	7 370 417 €
UBS PREFERED TV05	1 500	1 557 722 €
UBS STAM 5.875 16	3 550	2 925 397 €
UDR 4.25%11-2018	8 000	6 140 718 €
ULFP 2.25% 2018	1 263 000	1 298 477 €
UNCDBK AUT 2.625% 18	8 900 000	9 253 187 €
UNI DI BANC 3.75%15	2 500 000	2 591 866 €
UNIBAIL 1.875% 18	1 700 000	1 705 429 €
UNIBAIL 2.5% 2023	6 000 000	5 916 159 €
UNIBAIL ROD 3.875%17	4 022	4 383 449 €
UNIBAIL-ROD 1.625%17	3 600 000	3 650 713 €
UNIBAIL-ROD 2.375%21	11 400 000	11 542 347 €
UNICREDIT 2.75% 2020	1 125 000	1 177 305 €
UNICREDIT 4,375%20	100	1 116 043 €
UNICREDIT 4.875% 17	14 100 000	15 851 027 €
UNICREDIT 5,75%17	400	442 507 €
UNICREDIT 5.75%2025	12 344 000	12 718 855 €
UNICREDIT 6.95% 22	6 300 000	6 942 395 €
UNICREDIT BK 2.50%19	3 800 000	3 751 956 €
UNICREDITO 2.25% 16	6 700 000	6 760 062 €
UNICREDITO 5.25 14	1 739	1 829 983 €
UNION BK 3% 2016	7 400	5 620 649 €
UNION BK NA 1.5% 16	985 000	723 754 €
UNION PAC 4.163%2022	2 005	1 526 594 €
UNION PACIF 3.646%24	1 924 000	1 366 157 €
UNIQA INS.6.875% 43	5 000 000	5 499 943 €
UNITED PARC 2.45% 22	1 850 000	1 244 739 €
UNITEDHEALTH 6.5% 37	2 480	2 153 530 €
UNITEDTECH 3.10 2022	3 400 000	2 419 490 €
UNITEDTECH 4.50 2042	2 735 000	1 921 775 €
UNTD AIR 4.30%2025	3 000 000	2 224 780 €
US AIR 3.95%13-2025	2 300 000	1 611 779 €
USA 0.75% 03/18	65 000	45 912 €
USA 2.75% 11/23	190 000	135 119 €
USA 3.75% 11/43	7 425 000	5 209 146 €
UTD HEALTH 4.25%43	2 275 000	1 500 790 €
UTD HEALTH 6% 02/18	3 000	2 566 928 €
VALE 5.625% 09/42	3 200 000	2 124 436 €
VALE SA 3.75% 23	3 500 000	3 612 102 €
VALEO 4.875 05/2018	2 000 000	2 303 710 €
VALEO 5.75% 2017	700 000	827 051 €
VALERO 4.5% 10-2015	3 560	2 733 532 €
VALERO 6.125%10-2020	6 450	5 450 372 €
VALERO EN 6.625 37	2 977	2 454 895 €
VALLOUREC 4.25% 17	4 000 000	4 498 716 €
VAN LAN B 4.625% 14	2 000	2 084 137 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
VAN LAN BK 2.87% 16	2 200 000	2 252 338 €
VAN LAN BK 3.12% 18	1 000 000	1 033 588 €
VATTENFALL 5.25%49	1 000 000	1 067 093 €
VATTENFALL TREASURY	130	8 398 369 €
VENTAS REA 1.55% 16	1 025 000	749 566 €
VENTAS REA 3.25% 22	921 000	624 112 €
VENTAS REAL 4.25%22	4 120 000	3 029 965 €
VENTAS REALTY 2.7%20	3 725 000	2 594 456 €
VEOLIA 4.247% 2021	1 500 000	1 656 435 €
VEOLIA ENVIRONNEMENT	5 250 000	6 299 072 €
VER COM 8.25%11-18	265	249 122 €
VERIZ WIRL 8.75% 15	4 600	5 313 666 €
VERIZON 5.5 02/18	5 800	4 837 550 €
VERIZON 6,40%38 SR	1 560	1 297 800 €
VERIZON 7,75%30	1 675	1 555 073 €
VERIZON COMM 2.45%22	4 860 000	3 139 349 €
VERIZON COMM 3.65%18	9 500 000	7 368 274 €
VERIZON COMM 3.85%42	4 400 000	2 598 300 €
VERIZON COMM 5.15%23	15 950 000	12 577 569 €
VERIZON COMM 6.40%33	3 725 000	3 136 932 €
VERIZON COMM 6.55%43	31 962 000	27 454 521 €
VIACOM 3.125%12-2022	2 500 000	1 680 171 €
VIACOM 5.625%150919	2 550	2 119 585 €
VIACOM NEW 5.85% 43	3 625 000	2 797 615 €
VIENNA INSU 5.5% 43	15 200 000	16 091 647 €
VIER GAS 3.125% 23	2 998 000	3 110 188 €
VIER GAS TRANS 2%20	13 970 000	13 914 501 €
VINCI 3.375%12-2020	7 700 000	8 379 027 €
VINCI 4.125% 04/20	1 450 000	1 644 761 €
VINCI 4.125% 2017	4 000 000	4 487 818 €
VINCI 6,25%06 PERP.	9 000 000	9 699 179 €
VIRG ELEC 4% 01/43	970 000	642 387 €
VIRG ELEC 6%06-2036	1 805	1 551 312 €
VIRGIN EL&PWR4.65%43	5 500 000	4 006 520 €
VIRGINIA ELE 6.35%37	4 600	4 049 930 €
VIVENDI 4.125 17	12 200 000	13 468 048 €
VIVENDI 4.25% 16	2 000 000	2 180 424 €
VIVENDI 4.875 %18	1 800 000	2 021 655 €
VIVENDI 4.875%2019	1 600 000	1 799 495 €
VIVENDI SA 2.375% 19	2 900 000	2 922 727 €
VIVFP 4.75% 2021	1 000 000	1 130 194 €
VODAFONE 1.25% 09/17	2 400 000	1 708 168 €
VODAFONE 2.95% 2023	8 600 000	5 745 731 €
VODAFONE 5,75%16	3 805	3 077 190 €
VODAFONE 5.45%09-19	1 630	1 342 501 €
VODAFONE 5.625% 17	1 730	1 431 304 €
VODAFONE 6.25% 01/16	500	584 589 €
VODAFONE 7.875 02/30	798	741 617 €
VOLKS LEAS 3.25 %18	108	11 809 896 €
VOLKSW LEAS 1.5% 15	2 300 000	2 337 637 €
VOLKSW LEAS 2.375%22	1 700 000	1 694 064 €
VOLKSWAGEN 1.875%17	1 609 000	1 666 318 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
VOLKSWAGEN 2% 21	13 250 000	13 235 971 €
VOLKSWAGEN 2.125%18	7 147 000	5 142 558 €
VOLKSWAGEN 3.875% 18	15 465 000	16 226 100 €
VOLKSWAGEN INT 2%20	5 537 000	5 645 811 €
VOLVO T AB 2.375% 17	6 543 000	6 489 071 €
VOLVO TREASUR.5%17	2 700	3 087 253 €
VORNADO 5% 15/01/22	7 400	5 698 038 €
VOTO VOTOR 5.25% 17	4 500 000	4 999 007 €
VW 2.125% 2015	459 000	475 209 €
VW 3.25% 2019	5 000 000	5 513 772 €
VW 3.375% 2016	9	972 752 €
VZ 5.85 15/09/35	4 700	3 659 981 €
WACHOVIA 4 3/8%16	60	3 310 945 €
WACHOVIA 4 3/8%18	57	3 130 339 €
WAL MART 4.875% 29	11 700	14 120 743 €
WAL MART 5.25% 35	3 640	2 895 434 €
WALMART 3.625% 0720	2 410	1 867 192 €
WAL-MART 6,20%38	1 770	1 569 351 €
WAL-MART 6,50%37	585	538 247 €
WATSON PHAM 4.625%42	3 805 000	2 537 343 €
WEATH INTL 4.50% 22	5 000 000	3 673 797 €
WEATHER 9.625%2019	1 800	1 715 689 €
WEATHERFORD 5.95%42	3 615 000	2 632 051 €
WELLPOINT 4.65% 43	5 100 000	3 487 230 €
WELLPOINT 5.10%2044	1 925 000	1 402 027 €
WELLPT 4.625%2042	1 575 000	1 049 237 €
WELLS 5.95%06-2036	4 015	3 333 118 €
WELLS 4 1/8%16	7 700	8 414 428 €
WELLS FAR 3.5% 03/22	14 000 000	10 243 524 €
WELLS FARGO 1.5% 18	4 115 000	2 977 240 €
WELLS FARGO 2.15%19	2 750 000	1 994 096 €
WELLS FARGO 2.25% 23	4 994 000	4 894 067 €
WELLS FARGO 2.25%20	19 634 000	19 743 273 €
WELLS FARGO 3.45% 23	4 990 000	3 443 184 €
WELLS FARGO 3.676 16	3 945	3 076 849 €
WELLS FARGO 4.125%23	1 700 000	1 227 687 €
WELLS FARGO 4.6%2021	3 200	2 554 493 €
WESFARMERS 2.75% 22	18 740 000	18 969 167 €
WEST RETAIL 3.25%23	6 821 000	6 990 214 €
WESTAR ENR 4.125% 42	2 500 000	1 649 671 €
WESTERN 5.93% 10/16	4 000	3 264 935 €
WESTERN GA 5.375% 21	1 610 000	1 248 537 €
WESTERN GAS 4%2022	800 000	550 841 €
WESTERN UNI 2.375%15	2 045 000	1 518 954 €
WESTERN UNI 2.875%17	3 333 000	2 469 106 €
WESTPAC 3.875%10-17	3 330	3 698 585 €
WESTPAC B 4.625 18	2 900	2 267 124 €
WEYERHAEUSER4.625%23	1 880 000	1 399 946 €
WHIRLPOOL 5.15%2043	4 215 000	2 996 942 €
WILL COS 7.75% 31	511	397 790 €
WILL COS 7.875 21	1 400 000	1 203 228 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
WILL PART 5.25% 2020	1 141	914 901 €
WILLIA COS 8.75%32	743	641 776 €
WILLIAMS 4.125% 20	6 110	4 528 574 €
WILLIAMS COS 3.70%23	6 405 000	4 127 829 €
WILLIAMS PA 3.35 22	9 525 000	6 481 001 €
WILLIAMS PART 5.8%43	2 250 000	1 651 676 €
WILLIS GRP 5.75% 21	1 850	1 469 808 €
WILLIS NORTH 7%09-19	4 600	3 905 354 €
WILLOW N0.2 3.375%22	6 479 000	6 936 585 €
WISCONSIN EN 6.25%67	1 500	1 124 466 €
WMT 5.625% 2040	2 923 000	2 420 971 €
WOLTERS K 6.375%18	4 000	4 935 049 €
WPP 5,25%300115	1 742	1 908 671 €
WPP FIN 3% 2023	5 900 000	5 875 297 €
WPP GROUP PLC	3 000	3 515 550 €
WPS RES 6.11%2066	1 500	1 095 755 €
WYETH 5.45% 07-2017	2 845	2 352 275 €
WYETH 5.95 04/37	1 320	1 119 803 €
WYETH TF6.5% 03/2034	475	428 984 €
WYNDHAM WOR 4.25% 22	7 700 000	5 539 971 €
XCEL ENERGY 4.8%41	2 000	1 427 215 €
XEL 4.50% 2041	3 900 000	2 695 059 €
XEROX 4.25%15 SR	9 680	7 392 431 €
XEROX CORP 2.95%17	809 000	609 058 €
XL CAPITAL 5,25%14	1 140	864 847 €
XL GROUP 5.75%2021	1 450	1 198 466 €
XSTRATA 2.375% 2018	1 500 000	1 520 388 €
XSTRATA FIN 1.5%2016	500 000	509 462 €
XSTRTA CDA 5.25 17	500	571 672 €
YAPI 5.25% 12/18	3 150 000	2 223 775 €
YUM 6.875% 15/11/37	233	192 570 €
YUM BRANDS 3.87% 20	1 820	1 348 095 €
YUM BRANDS 6.25% 18	1 149	975 796 €
ZAPAD ENRG 2.875% 18	3 300 000	3 388 263 €
ZFS FIN.6,45%65	1 565	1 222 836 €
ZIGGO BV 3.625% 20	3 504 000	3 599 924 €
ZURICH 7.50%09-2039	67	4 109 678 €

SHORT TERM NOTES

TOTAL (€)	471 149 658 €
------------------	----------------------

Security name	Quantity	Stock price (€)
CR31 0.12% 17/01/13	15 000 000	15 000 175 €
CR31 0.17% 10/05/13	15 000 000	14 990 737 €
CR01 0.066% 29/03/13	21 400 000	21 393 877 €
CR01 0.17% 27/06/13	15 000 000	14 984 250 €
CR01 0.195% 19/07/13	10 000 000	9 988 793 €
CR01 0.20% 13/09/13	15 000 000	14 978 797 €
CR01 0.13% 27/09/13	15 000 000	14 995 841 €
CR01 0.06% 25/10/13	15 000 000	14 998 876 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
CR01 0.1% 06/12/13	15 000 000	14 995 830 €
CR01 0.184% 22/11/13	15 000 000	14 989 957 €
CR01 0.165% 17/10/13	20 000 000	19 964 702 €
CR01 0.23% 13/12/13	10 000 000	9 981 863 €
CR07 0.18% 12/11/13	250 000 000	249 913 516 €
CR31 0.116% 29/07/13	10 000 000	9 995 346 €
CR31 0.175% 14/10/13	15 000 000	14 983 057 €
CR31 0.18% 04/11/13	15 000 000	14 994 042 €

MUTUAL FUNDS

TOTAL (€)	5 329 605 509 €
------------------	------------------------

Security name	Quantity	Stock price (€)
ABERDEEN GL-ETHICAL	675 000	7 365 600 €
ABERDEN GL EMERG MKT	14 837 926	102 151 135 €
ALLIANZ EURO HIGH	33 802	62 474 013 €
AMUNDI ACT.EMERG.I2	12	64 193 413 €
AVIVA I EMERG. MARKT	91 402	78 093 448 €
AXA WORLD FUNDS	1 405 077	199 345 760 €
BAER LOC.EM.C 3DEC	1 651 178	389 648 660 €
BFT MONET.SI.3DEC	22 576	304 520 479 €
BLACKROCK FONDS INDI	24 688 592	348 232 584 €
BNP CASH INVEST I	556	31 773 176 €
BNP PARIBAS AQUA I	135	3 177 091 €
BNY MELLON GL-EMM	233 068 313	287 398 483 €
CARMIG EM PATRT A	527 287	51 125 758 €
CIP EM.TOT.OPP A7C	7 299 270	65 766 423 €
COMGEST EMERG 3DEC	6 235 000	152 221 061 €
DIMENSIONAL EMERG	7 808 131	126 023 237 €
FIDELITY FUNDS HIGH	13 562 905	102 270 547 €
FRANK TEMP INV EMKT	23 637 285	422 174 013 €
HSBC EU.C.H.I	2 668 081	101 216 303 €
HSBC GIF GL	4 291 345	104 298 460 €
JANUS CAP FUND HIGH	723 377	58 478 127 €
JULIUS BAER MULTI SI	218 000	3 775 760 €
JUPITER ECOLOGY CL.I	1 100 000	3 873 534 €
KBI AGRI FUND	65 775	7 877 576 €
KBI INST ALTE ENERGY	1 854 533	10 133 167 €
KBI INST WATER FUND	1 294 565	21 177 787 €
KBI INSTL EUR-A-AC	83 813	11 415 022 €
LBPAM TRES.I 5DEC	9 355	102 328 679 €
NEUBER BERGMAN	19 364 862	280 656 289 €
PARVEST ENVIRT OPPO	60	7 811 299 €
PICTET CLEAN ENERG	144 000	9 465 120 €
PICTET FUND LUX	1 579 142	227 742 957 €
PICTET FUNDS LUX -EM	273 895	68 198 507 €
PICTET WATER CL.I	32 500	7 042 100 €
PIMCO EMERGING	13 003 647	126 365 363 €
PIONEER FUNDS ECOLO	11 337	12 272 261 €
PIONEER FUNDS EUR HG	52 612	87 232 654 €

Security name	Quantity	Stock price (€)
SARASIN FONDS INVEST	68 000	9 475 120 €
SCHRODER SICAV	332 000	3 917 600 €
SCHRODERS INTL EMERG	15 153 975	185 030 036 €
STONE HARBOR-EM MKLC	3 527 672	353 253 653 €
SWISSCANTO LU EQTY	53 000	7 069 140 €
THRE.EUR.H.Y. EUR	27 482 109	66 328 071 €
TOBAM	6 880	50 955 138 €
VANGUARD EMERG MK	5 088 446	593 049 216 €
VONTOBEL NEW POWER I	131 500	11 211 690 €

PRIVATE EQUITY

TOTAL (€)	627 213 028 €
------------------	----------------------

Security name	Quantity	Stock price (€)
ANTIN INFRASTRUCT. A	495 000	39 049 469 €
ANTIN INFRASTRUCT. B	500 000	500 000 €
AXA SEC. FUND IV LP	1	97 569 112 €
LEHMAN BROTHERS INTE	1	154 496 424 €
LP ACCESS CAPITAL PA	1	145 124 120 €
PANTHEON FRR EUROPE	1	190 473 902 €

SECURITISATION VEHICULE

TOTAL (€)	36 984 245 €
------------------	---------------------

Security name	Quantity	Stock price (€)
IDINVEST FCT 24	3 052	30 958 936 €
FCT NOVO 2	59	3 010 765 €
FCT NOVO 1	60	3 014 544 €