

# AMC PROFESSIONAL FUND - BCV Swiss Franc Bonds ESG

## Rapport semestriel au 30 septembre 2023

---

### Table des matières

Direction du fonds et organisation .....	2
Information aux investisseurs .....	3
Chiffres comptables .....	5
Inventaire et transactions .....	9
Notes aux états financiers .....	48
Rapport de performance .....	49



Pl. St-François 14  
Case postale 300  
CH-1001 Lausanne

[www.bcv.ch/invest](http://www.bcv.ch/invest)



Rue du Maupas 2  
Case postale 691  
CH-1001 Lausanne

[www.gerifonds.ch](http://www.gerifonds.ch)

## Direction du fonds et organisation

---

### Direction du fonds

GERIFONDS SA  
Rue du Maupas 2  
Case postale 691  
1001 Lausanne

### Conseil d'administration

Stefan BICHSEL  
Président

Oren-Olivier PUDER  
Vice-président

Fabrice WELSCH  
Membre

Patrick BOTTERON  
Membre

Simona TERRANOVA  
Membre

### Organe de gestion

Christian CARRON, Chief Executive Officer  
Bertrand GILLABERT, Chief Financial Officer  
Sandra BERCHIER, Chief Compliance Officer  
Frédéric NICOLA, Chief Fund Risk & Regulatory Officer  
Antonio SCORRANO, Chief Operating Officer

### Banque dépositaire

Banque Cantonale Vaudoise, Lausanne

### Société d'audit

PricewaterhouseCoopers SA  
Avenue Giuseppe-Motta 50  
1202 Genève

### Domicile(s) de souscription et de paiement

Banque Cantonale Vaudoise, Lausanne

### Gestion du fonds

GERIFONDS SA a délégué la gestion du fonds  
à Banque Cantonale Vaudoise, Lausanne

### Conseiller ESG

ETHOS SERVICES SA, Genève

## Information aux investisseurs

### 1) Changement de société d'audit

PricewaterhouseCoopers SA, Genève, a été désignée comme société d'audit du fonds, en remplacement de KPMG SA, Genève. La nouvelle société d'audit assumera cette fonction depuis l'exercice annuel clôturant au 31 mars 2024.

### 2) Regroupement au 31 mars 2023 du fonds Ethos Bonds CHF de l'ombrelle ETHOS dans le fonds BCV Swiss Franc Bonds ESG

Conformément à la décision de l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers FINMA du 20 mars 2023, tel que publiée sur la plateforme électronique [www.swissfunddata.ch](http://www.swissfunddata.ch) le 3 avril 2023, le fonds Ethos Bonds CHF (fonds repris) de l'ombrelle ETHOS a été regroupé dans le fonds BCV Swiss Franc Bonds ESG (fonds repreneur) avec effet au 31 mars 2023.

A la date du regroupement, les porteurs de parts des classes de parts A, B et C du fonds repris ont reçu d'office et sans frais un nombre de parts d'une valeur correspondante des classes de parts A, B et C du fonds repreneur. La classe de parts Z du fonds repris n'était pas ouverte à la date du regroupement.

L'exécution régulière du regroupement a été confirmée par la société d'audit le 13 avril 2023. L'exécution du regroupement, la confirmation de la société d'audit et le rapport d'échange ont été publiés le 13 avril 2023 sur la plateforme électronique [www.swissfunddata.ch](http://www.swissfunddata.ch).

Compte tenu de ce qui précède, les chiffres au 31 mars 2023 publiés dans le présent rapport semestriel ne concernent que le fonds repreneur, avant l'exécution du regroupement tel que décrit ci-dessus.

### 3) Distribution intermédiaire des revenus au 1<sup>er</sup> septembre 2023 pour la classe de parts A

Une partie importante des parts en circulation de la classe de parts A a été demandée au remboursement le 1<sup>er</sup> septembre 2023.

Conformément aux exigences de l'Administration fédérale des contributions AFC, une distribution intermédiaire des revenus a eu lieu pour cette classe de parts le 1<sup>er</sup> septembre 2023 (date d'exécution) et payée le 5 septembre 2023 (date de paiement).

Les montants brut et net par part ont été les suivants :

				Montant pour porteurs de parts domiciliés			
				en Suisse			à l'étranger
Classe de parts	Affidavit	Coupon	Monnaie	Brut par part	Impôt anticipé fédéral moins 35%	Net par part	Brut/Net par part
A	Non	No 17	CHF	0.13501	0.04725	0.08776	0.08776

**4) Remboursement en nature et distribution intermédiaire des revenus au 13 septembre 2023 pour la classe de parts Z**

Une partie importante des parts en circulation de la classe de parts Z a été demandée au remboursement le 13 septembre 2023. La direction du fonds a accepté, aux conditions du § 18 du contrat de fonds, leur remboursement en nature.

Conformément aux exigences de l'Administration fédérale des contributions AFC, une distribution intermédiaire des revenus a eu lieu pour cette classe de parts le 13 septembre 2023 (date d'exécution) et payée le 15 septembre 2023 (date de paiement).

Les montants brut et net par part ont été les suivants :

				Montant pour porteurs de parts domiciliés			
				en Suisse			à l'étranger
Classe de parts	Affidavit	Coupon	Monnaie	Brut par part	Impôt anticipé fédéral moins 35%	Net par part	Brut/Net par part
Z	Non	No 6	CHF	0.53737432	0.18808	0.34929	0.34929

## Chiffres comptables

Aperçu		Devise	01.04.23	01.04.22	01.04.21
			30.09.23	31.03.23	31.03.22
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	consolidée	CHF	1'546'812'157.36	2'072'998'529.30	1'766'077'966.67
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	classe A	CHF	3'792'389.96	15'691'597.51	16'283'303.56
Valeur nette d'inventaire d'une part à la fin de la période comptable	classe A	CHF	92.29	90.71	95.66
Total Expense Ratio (TER)	classe A		0.61%	0.60%	0.60%
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	classe B	CHF	438'804'016.75	183'034'284.06	163'205'992.61
Valeur nette d'inventaire d'une part à la fin de la période comptable	classe B	CHF	92.58	90.74	95.98
Total Expense Ratio (TER)	classe B		0.31%	0.30%	0.30%
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	classe C	CHF	487'957'661.70	483'557'676.59	412'053'726.67
Valeur nette d'inventaire d'une part à la fin de la période comptable	classe C	CHF	90.80	88.98	94.08
Total Expense Ratio (TER)	classe C		0.26%	0.25%	0.25%
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	classe Z	CHF	616'258'088.95	1'390'714'971.14	1'174'534'943.83
Valeur nette d'inventaire d'une part à la fin de la période comptable	classe Z	CHF	92.28	90.85	96.20
Total Expense Ratio (TER)	classe Z		0.04%	0.03%	0.03%

Le TER a été calculé et est publié conformément à la directive de l'Asset Management Association Switzerland AMAS.

<b>Compte de fortune (Valeurs vénales)</b>	<b>30.09.23</b>	<b>31.03.23</b>
Avoirs en banque		
à vue	18'622'432.15	127'601'556.07
Valeurs mobilières		
Obligations, obligations convertibles, emprunts à option et autres titres de créance et droits-valeurs	1'519'544'329.38	1'935'381'168.96
Autres actifs	8'875'689.55	10'205'614.37
<b>Fortune totale du fonds à la fin de la période comptable</b>	<b>1'547'042'451.08</b>	<b>2'073'188'339.40</b>
Autres engagements	-230'293.72	-189'810.10
<b>Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable</b>	<b>1'546'812'157.36</b>	<b>2'072'998'529.30</b>

<b>Evolution du nombre de parts de la classe A</b>	<b>Période comptable</b>	<b>01.04.23</b>	<b>01.04.22</b>
		<b>30.09.23</b>	<b>31.03.23</b>
Position au début de la période comptable		172'983.000	170'225
Parts émises		346'914.000	6'849
Parts émises lors du regroupement *)		153'731.645	0
Parts rachetées		-632'536.690	-4'091
<b>Position à la fin de la période comptable</b>		<b>41'091.955</b>	<b>172'983</b>

<b>Evolution du nombre de parts de la classe B</b>	<b>Période comptable</b>	<b>01.04.23</b>	<b>01.04.22</b>
		<b>30.09.23</b>	<b>31.03.23</b>
Position au début de la période comptable		2'017'134.000	1'700'482
Parts émises		1'230'448.515	508'624
Parts émises lors du regroupement *)		1'646'571.283	0
Parts rachetées		-154'348.839	-191'972
<b>Position à la fin de la période comptable</b>		<b>4'739'804.959</b>	<b>2'017'134</b>

<b>Evolution du nombre de parts de la classe C</b>	<b>Période comptable</b>	<b>01.04.23</b>	<b>01.04.22</b>
		<b>30.09.23</b>	<b>31.03.23</b>
Position au début de la période comptable		5'434'588.00	4'379'883
Parts émises		118'688.00	1'516'865
Parts émises lors du regroupement *)		995.32	0
Parts rachetées		-180'522.32	-462'160
<b>Position à la fin de la période comptable</b>		<b>5'373'749.00</b>	<b>5'434'588</b>

<b>Evolution du nombre de parts de la classe Z</b>	<b>Période comptable</b>	<b>01.04.23</b>	<b>01.04.22</b>
		<b>30.09.23</b>	<b>31.03.23</b>
Position au début de la période comptable		15'307'917	12'209'637
Parts émises		260'726.221	3'558'135
Parts rachetées		-8'890'520	-459'855
<b>Position à la fin de la période comptable</b>		<b>6'678'123.221</b>	<b>15'307'917</b>

	<b>01.04.23</b>	<b>01.04.22</b>
<b>Variation de la fortune nette du fonds</b>	<b>30.09.23</b>	<b>31.03.23</b>
Fortune nette du fonds au début de la période comptable	2'072'998'529.30	1'766'077'966.67
Fortune reprise lors du regroupement	163'443'233.08	0.00
Distribution prévue lors de la dernière clôture annuelle	0.00	-7'843'903.90
Distribution intermédiaire des revenus	-8'407'768.17	-10'137'921.75
Solde des mouvements de parts	-729'315'472.07	405'754'804.97
Résultat total	48'093'635.22	-80'852'416.69
<b>Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable</b>	<b>1'546'812'157.36</b>	<b>2'072'998'529.30</b>

\*) Regroupement de la fortune du fonds ETHOS - Ethos Bonds CHF avec la fortune du fonds AMC PROFESSIONAL FUND - BCV Swiss Franc Bonds ESG au 31.02.2023.

Compte de résultat	Période comptable	01.04.23	01.04.22
		30.09.23	31.03.23
<b>Revenus</b>			
Revenus des avoirs en banque			
à vue		74'906.78	0.00
Intérêts négatifs		0.00	-86'045.00
Revenus des valeurs mobilières			
Obligations, obligations convertibles, emprunts à option et autres titres de créance et droits-valeurs		10'763'440.71	12'640'071.13
Participation des souscripteurs aux revenus nets courus		406'975.88	2'268'668.72
<b>Total des revenus</b>		11'245'323.37	14'822'694.85
<b>Charges</b>			
Frais de révision		-3'231.00	0.00
Bonifications réglementaires			
Commission forfaitaire de gestion		-1'501'452.92	-2'032'713.46
Autres charges		-49'494.80	-76'178.80
Participation des porteurs de parts sortants aux revenus nets courus		-122'854.17	-228'505.68
<b>Total des charges</b>		-1'677'032.89	-2'337'397.94
<b>Résultat net avant ajustements</b>		9'568'290.48	12'485'296.91
Gains et pertes de capital réalisés		-58'225'786.31	-29'843'037.53
<b>Résultat réalisé</b>		-48'657'495.83	-17'357'740.62
Gains et pertes de capital non réalisés		96'751'131.05	-63'494'676.07
<b>Résultat total</b>		48'093'635.22	-80'852'416.69



## Inventaire et transactions

### Inventaire de la fortune du fonds à la fin de la période comptable

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
<b>Valeurs mobilières cotées en bourse</b>						
<b>Obligations</b>					<b>1'515'542'089.38</b>	<b>97.97</b>
CH0419041667	0.07 % First Abu Dhabi Bank 19-27 NT	330'000	CHF	91.35 %	301'455.00	0.02
CH0474977714	0.205 % First Abu Dhabi Bank 19-25	490'000	CHF	95.85 %	469'665.00	0.03
CH0593893925	0.068 % First Abu Dhabi Bank 21-27 NT	3'750'000	CHF	92.70 %	3'476'250.00	0.23
CH1181713616	1.0625 % First Abu Dhabi Bank 22-26 NT	850'000	CHF	97.20 %	826'200.00	0.06
<b>Emirats arabes unis</b>					<b>5'073'570.00</b>	<b>0.34</b>
CH1160382979	1.285 % Macquarie Group 22-29	2'180'000	CHF	92.80 %	2'023'040.00	0.13
<b>Australie</b>					<b>2'023'040.00</b>	<b>0.13</b>
CH0020632144	2 7/8 % OEKB 05-30	2'380'000	CHF	107.75 %	2'564'450.00	0.17
CH0027752200	2 5/8 % OEKB 06-24	385'000	CHF	100.95 %	388'657.50	0.03
CH0441186480	1/4 % Hypo Vorarlberg Bank 18-25	2'225'000	CHF	96.55 %	2'148'237.50	0.14
CH0525158462	1/8 % Hypo Vorarlberg Bank 20-30 NT	1'990'000	CHF	85.00 %	1'691'500.00	0.11
CH0593893917	1/8 % Hypo Vorarlberg Bank 21-28	2'090'000	CHF	88.85 %	1'856'965.00	0.12
CH1166151972	1/2 % Hypo Vorarlberg Bank 22-27	1'470'000	CHF	95.30 %	1'400'910.00	0.09
CH1216400049	2.87 % BAWAG 22-25	1'210'000	CHF	100.80 %	1'219'680.00	0.08
CH1231094363	1.96 % BAWAG P.S.K. Versicherung 23-31	1'630'000	CHF	100.10 %	1'631'630.00	0.11
CH1233900013	2 3/8 % Hypo Vorarlberg Bank 23-26	1'140'000	CHF	100.35 %	1'143'990.00	0.07
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 23-28	980'000	CHF	100.20 %	981'960.00	0.06
CH1289657095	1 7/8 % Hypo Vorarlberg Bank 23-30	2'540'000	CHF	99.95 %	2'538'730.00	0.16
<b>Autriche</b>					<b>17'566'710.00</b>	<b>1.14</b>
CH0463112042	0.578 % FONPLATA 19-24	1'000'000	CHF	99.13 %	991'300.00	0.06
CH0593893933	0.556 % FONPLATA 21-26	850'000	CHF	93.50 %	794'750.00	0.05
CH1142754287	0.795 % FONPLATA 21-28	1'300'000	CHF	89.05 %	1'157'650.00	0.08
<b>Bolivie</b>					<b>2'943'700.00</b>	<b>0.19</b>
CH0258404455	3/4 % Province of Quebec 14-24 NT	1'430'000	CHF	98.85 %	1'413'555.00	0.09
CH0367206759	1/4 % Province of Ontario 17-29	260'000	CHF	92.05 %	239'330.00	0.02
CH0460054452	1/4 % Province of Manitoba 19-29 NT	1'730'000	CHF	92.40 %	1'598'520.00	0.10
CH1112011510	0.05 % Province of Ontario 21-33	650'000	CHF	84.35 %	548'275.00	0.04
CH1117896477	0.03 % Province of Quebec 21-31 NT	1'170'000	CHF	87.65 %	1'025'505.00	0.07
CH1163572931	0.525 % Province of Saskatchewan 22-32	720'000	CHF	89.80 %	646'560.00	0.04
CH1264823431	2.04 % Province of Quebec 23-33	2'240'000	CHF	102.25 %	2'290'400.00	0.14
<b>Canada</b>					<b>7'762'145.00</b>	<b>0.50</b>
CH0008680370	4 % Confederation Suisse 98-28	9'560'000	CHF	112.90 %	10'793'240.00	0.70
CH0009755197	4 % Confederation Suisse 99-49	1'790'000	CHF	163.90 %	2'933'810.00	0.19
CH0015803239	3 1/2 % Confederation Suisse 03-33	1'460'000	CHF	121.65 %	1'776'090.00	0.11

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0020498645	2 3/4 % Stadt Zuerich 05-25	980'000	CHF	101.35 %	993'230.00	0.06
CH0020810468	3 % Luzerner KB 05-25	1'075'000	CHF	101.51 %	1'091'232.50	0.07
CH0024524966	2 1/2 % Confederation Suisse 06-36	9'390'000	CHF	116.07 %	10'898'973.00	0.70
CH0025185676	3 % Eurofima 06-26	3'910'000	CHF	103.45 %	4'044'895.00	0.26
CH0031835561	3 1/4 % Confederation Suisse 07-27	5'020'000	CHF	107.73 %	5'408'046.00	0.35
CH0115967397	2 1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 10-32 Series 519	2'150'000	CHF	103.50 %	2'225'250.00	0.14
CH0117076379	1 7/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 10-31 Series 524	5'930'000	CHF	100.60 %	5'965'580.00	0.39
CH0118095667	1 7/8 % Basler KB 10-26	3'260'000	CHF	100.10 %	3'263'260.00	0.21
CH0119015086	2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 10-25 Series 405	2'525'000	CHF	100.45 %	2'536'362.50	0.16
CH0120168486	2 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 10-28 Series 533	1'500'000	CHF	101.80 %	1'527'000.00	0.10
CH0124338937	2 5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 11-31 Series 548	6'070'000	CHF	105.85 %	6'425'095.00	0.42
CH0126977641	2 1/4 % Kanton Bern 11-26	880'000	CHF	101.45 %	892'760.00	0.06
CH0127181029	2 1/4 % Confederation Suisse 11-31	5'230'000	CHF	108.79 %	5'689'717.00	0.37
CH0127181169	1 1/2 % Confederation Suisse 12-42	10'130'000	CHF	106.26 %	10'764'138.00	0.70
CH0127181193	1 1/4 % Confederation Suisse 12-37	3'390'000	CHF	101.78 %	3'450'342.00	0.22
CH0132163434	2 7/8 % KW Linth-Limmern 11-31	570'000	CHF	103.05 %	587'385.00	0.04
CH0138760811	1 5/8 % Stadt Bern 11-24	620'000	CHF	99.79 %	618'698.00	0.04
CH0139458720	1 1/2 % Canton de Geneve 11-24	3'260'000	CHF	99.68 %	3'249'568.00	0.21
CH0141833407	1 3/4 % Basellandschaftliche KB 11-24	3'260'000	CHF	99.81 %	3'253'806.00	0.21
CH0142132031	1 1/2 % Canton de Geneve 12-28	650'000	CHF	99.40 %	646'100.00	0.04
CH0143808340	1 1/4 % Kanton Bern 12-27	1'300'000	CHF	98.65 %	1'282'450.00	0.08
CH0147144361	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 12-28 Series 562	4'570'000	CHF	98.90 %	4'519'730.00	0.29
CH0149549575	1 1/2 % Basler KB 12-27	1'370'000	CHF	98.95 %	1'355'615.00	0.09
CH0180428531	2 7/8 % KW Linth-Limmern 12-42	285'000	CHF	104.00 %	296'400.00	0.02
CH0181215028	1 3/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 12-27 Series 420	2'325'000	CHF	98.71 %	2'295'007.50	0.15
CH0184043542	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 12-27 Series 566	1'960'000	CHF	99.15 %	1'943'340.00	0.13
CH0190369378	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 12-33 Series 569	780'000	CHF	97.06 %	757'068.00	0.05
CH0192241278	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 12-27 Series 572	330'000	CHF	98.56 %	325'248.00	0.02
CH0193395537	1 1/4 % Canton de Neuchatel 12-27	1'370'000	CHF	98.30 %	1'346'710.00	0.09
CH0194273204	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 12-29 Series 574	3'880'000	CHF	97.80 %	3'794'640.00	0.25
CH0194958960	3 % KW Linth-Limmern 12-52	510'000	CHF	104.05 %	530'655.00	0.03
CH0200044789	2 3/8 % Nant de Drance 13-28	220'000	CHF	100.50 %	221'100.00	0.01
CH0200044805	1 7/8 % KW Oberhasli 13-25	290'000	CHF	99.65 %	288'985.00	0.02
CH0204811100	1 5/8 % Swissgrid 13-25	475'000	CHF	99.53 %	472'767.50	0.03
CH0206728823	1 1/2 % Stadt Bern 13-28	1'960'000	CHF	99.55 %	1'951'180.00	0.13
CH0206894740	1 3/8 % Graubundner KB 13-25	2'485'000	CHF	99.27 %	2'466'859.50	0.16
CH0206992270	1 1/2 % Thurgauer KB 13-27	1'960'000	CHF	98.80 %	1'936'480.00	0.13
CH0208271541	3 % KW Linth-Limmern 13-48	850'000	CHF	106.70 %	906'950.00	0.06
CH0211588949	1 5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 13-30 Series 581	330'000	CHF	99.00 %	326'700.00	0.02
CH0217756656	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 13-25 Series 584	4'730'000	CHF	99.90 %	4'725'270.00	0.31
CH0217825311	1 3/4 % Kanton St-Gallen 13-28	1'960'000	CHF	101.25 %	1'984'500.00	0.13
CH0221999813	1 5/8 % Stadt Zuerich 13-24	5'320'000	CHF	100.00 %	5'320'000.00	0.34
CH0222261494	1 3/4 % Thurgauer KB 13-24	2'020'000	CHF	99.82 %	2'016'364.00	0.13
CH0224396983	1 1/4 % Confederation Suisse 14-26	7'700'000	CHF	100.28 %	7'721'560.00	0.50
CH0224397007	2 % Confederation Suisse 14-64	200'000	CHF	134.15 %	268'300.00	0.02
CH0224397171	1/2 % Confederation Suisse 15-30	13'025'000	CHF	96.57 %	12'578'242.50	0.81
CH0224397338	1/2 % Confederation Suisse 16-58	5'020'000	CHF	83.68 %	4'200'736.00	0.27
CH0224397346	0 % Confederation Suisse 16-29	16'280'000	CHF	94.21 %	15'337'388.00	1.04

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0224485927	2 % Canton de Vaud 13-33	1'300'000	CHF	103.00 %	1'339'000.00	0.09
CH0224923513	1 3/4 % Schaffhauser KB 13-25	980'000	CHF	99.70 %	977'060.00	0.06
CH0228531437	2 3/8 % KW Linth-Limmern 13-26	1'805'000	CHF	100.80 %	1'819'440.00	0.12
CH0235475354	1 5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 14-26 Series 445	490'000	CHF	99.70 %	488'530.00	0.03
CH0239840124	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 14-24 Series 591	1'570'000	CHF	99.48 %	1'561'836.00	0.10
CH0241926317	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 14-25 Series 593	2'710'000	CHF	99.40 %	2'693'740.00	0.17
CH0244175201	1 1/4 % Banque Cantonale de Fribourg 14-24	3'330'000	CHF	99.51 %	3'313'683.00	0.21
CH0252379802	1 7/8 % Mobimo Holding 14-24	1'210'000	CHF	99.50 %	1'203'950.00	0.08
CH0252703050	1 1/4 % KW Linth-Limmern 14-24	1'400'000	CHF	99.16 %	1'388'240.00	0.09
CH0252903767	1 3/8 % Kanton Basel-Stadt 14-34	1'080'000	CHF	96.65 %	1'043'820.00	0.07
CH0254212233	1 % Kanton Zuerich 14-27	680'000	CHF	97.90 %	665'720.00	0.04
CH0255678333	1 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 14-26 Series 598	2'840'000	CHF	98.00 %	2'783'200.00	0.18
CH0255678341	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 14-32 Series 599	1'980'000	CHF	96.25 %	1'905'750.00	0.12
CH0257042173	2 % Swiss Prime Site Finance 14-24	650'000	CHF	99.77 %	648'505.00	0.04
CH0261399064	1 1/8 % Baloise-Holding 14-24	460'000	CHF	98.92 %	455'032.00	0.03
CH0262883199	1 3/8 % Grande Dixence 15-25	1'075'000	CHF	98.84 %	1'062'530.00	0.07
CH0263432988	1 % Centr. LdG Bques Cant. CH 14-28 Series 459	3'000'000	CHF	96.47 %	2'894'100.00	0.19
CH0264227015	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 14-25 Series 603	3'650'000	CHF	98.28 %	3'587'220.00	0.23
CH0265801198	0.55 % Banque Cantonale de Fribourg 15-25	1'010'000	CHF	98.20 %	991'820.00	0.06
CH0267222310	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-30 Series 604	3'070'000	CHF	91.77 %	2'817'339.00	0.18
CH0267855986	1/8 % Kanton Baselland 15-26	1'170'000	CHF	96.60 %	1'130'220.00	0.07
CH0268786982	5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-30 Series 460	3'120'000	CHF	93.10 %	2'904'720.00	0.19
CH0268988182	1 % Swisscom 15-35 Tranche 2	1'340'000	CHF	90.50 %	1'212'700.00	0.08
CH0269697931	3/8 % Schaffhauser KB 15-27	1'960'000	CHF	95.25 %	1'866'900.00	0.12
CH0269796212	1/2 % Thurgauer KB 15-29	650'000	CHF	92.95 %	604'175.00	0.04
CH0270190983	1/4 % Novartis 15-25	520'000	CHF	97.60 %	507'520.00	0.03
CH0270190991	5/8 % Novartis 15-29	1'775'000	CHF	93.25 %	1'655'187.50	0.11
CH0270191007	1.05 % Novartis 15-35	580'000	CHF	90.80 %	526'640.00	0.03
CH0271288547	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-28 Series 605	2'670'000	CHF	94.44 %	2'521'548.00	0.16
CH0272154177	1 % Kanton Baselland 15-40	120'000	CHF	89.75 %	107'700.00	0.01
CH0273347838	1 3/8 % Allreal Holding 15-25	1'355'000	CHF	98.71 %	1'337'520.50	0.09
CH0273485398	5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-29 Series 462	2'095'000	CHF	93.85 %	1'966'157.50	0.13
CH0274253514	0.60 % Banque Cantonale de Fribourg 15-27	4'140'000	CHF	95.60 %	3'957'840.00	0.26
CH0274314787	3/4 % Basellandschaftliche KB 15-28	1'300'000	CHF	95.30 %	1'238'900.00	0.08
CH0275352125	3/8 % Thurgauer KB 15-25	1'110'000	CHF	97.71 %	1'084'581.00	0.07
CH0276581094	0.55 % Spitalverband Limmattal 15-25	720'000	CHF	97.20 %	699'840.00	0.05
CH0278667115	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-30 Series 464	3'420'000	CHF	92.07 %	3'148'794.00	0.20
CH0279720343	1/4 % Basellandschaftliche KB 15-25	1'110'000	CHF	97.40 %	1'081'140.00	0.07
CH0280569135	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-34 Series 610	1'630'000	CHF	88.82 %	1'447'766.00	0.09
CH0282019006	1 1/4 % Services Industriels de Geneve 15-25	260'000	CHF	98.25 %	255'450.00	0.02
CH0282528899	7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-37 Series 611	2'180'000	CHF	88.20 %	1'922'760.00	0.12
CH0284087589	1/2 % St Galler KB 15-25	2'740'000	CHF	97.75 %	2'678'350.00	0.17
CH0284687404	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-25 Series 613	550'000	CHF	98.30 %	540'650.00	0.03
CH0285849367	5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-27 Series 466	7'630'000	CHF	96.00 %	7'324'800.00	0.47
CH0286138877	3/4 % Berner KB 15-25	1'875'000	CHF	98.00 %	1'837'500.00	0.12
CH0288286385	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-25 Series 467	4'470'000	CHF	97.67 %	4'365'849.00	0.28
CH0290876512	5/8 % Lugano 15-25	1'440'000	CHF	97.70 %	1'406'880.00	0.09
CH0291625231	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-26 Series 616	5'840'000	CHF	96.85 %	5'656'040.00	0.37

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0292984470	1 1/4 % Nant de Drance 15-23	1'870'000	CHF	99.94 %	1'868'878.00	0.12
CH0293026222	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-31 Series 617	2'220'000	CHF	91.80 %	2'037'960.00	0.13
CH0295186388	3/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-25 Series 469	3'460'000	CHF	97.29 %	3'366'234.00	0.22
CH0297132364	1 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-36 Series 619	6'905'000	CHF	90.80 %	6'269'740.00	0.41
CH0297343565	1/2 % Kanton Solothurn 15-30 Tranche 2	650'000	CHF	92.35 %	600'275.00	0.04
CH0299297280	3/4 % ZKB 15-30 Series 135	1'890'000	CHF	92.50 %	1'748'250.00	0.11
CH0300874283	5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-30 Series 471	4'040'000	CHF	92.30 %	3'728'920.00	0.24
CH0302424392	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-29 Series 621	5'670'000	CHF	93.21 %	5'285'007.00	0.34
CH0304755157	3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-34 Series 623	6'000'000	CHF	89.20 %	5'352'000.00	0.35
CH0305954569	1/4 % Kanton Aargau 15-29 Tr. 2	1'430'000	CHF	92.10 %	1'317'030.00	0.09
CH0306173730	1/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-26 Series 473	2'970'000	CHF	96.15 %	2'855'655.00	0.18
CH0306173748	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-30 Series 474	2'930'000	CHF	91.65 %	2'685'345.00	0.17
CH0306626224	2 % Nant de Drance 16-26	1'005'000	CHF	99.35 %	998'467.50	0.06
CH0307256435	1/2 % PSP Swiss Property 16-24	3'750'000	CHF	99.38 %	3'726'750.00	0.24
CH0307256450	0.60 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-35 Series 476	6'670'000	CHF	86.50 %	5'769'550.00	0.37
CH0310175564	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-26 Series 625	4'730'000	CHF	95.85 %	4'533'705.00	0.29
CH0310451858	1 1/4 % UBS Group Funding (Switzerland) 16-26 Tranche 2	400'000	CHF	97.90 %	391'600.00	0.03
CH0310646523	1/2 % Banque Cantonale de Fribourg 16-28	2'580'000	CHF	94.05 %	2'426'490.00	0.16
CH0312512640	1/4 % Graubuendner KB 16-28	650'000	CHF	93.20 %	605'800.00	0.04
CH0319415920	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-28 Series 627	420'000	CHF	92.40 %	388'080.00	0.03
CH0319415938	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-32 Series 628	3'570'000	CHF	89.10 %	3'180'870.00	0.21
CH0319416126	0.04 % Stadt Bern 16-27	1'760'000	CHF	94.50 %	1'663'200.00	0.11
CH0319932767	0.40 % BCV 16-31	3'055'000	CHF	88.35 %	2'699'092.50	0.17
CH0320712596	0.30 % Raiffeisen Suisse 16-25 Tranche 1	490'000	CHF	97.25 %	476'525.00	0.03
CH0326213912	1/4 % Kinderspital Zuerich - Eleonorenstiftung 16-28	1'720'000	CHF	92.20 %	1'585'840.00	0.10
CH0326213920	0.60 % Canton de Geneve 16-46	1'370'000	CHF	78.55 %	1'076'135.00	0.07
CH0328298069	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-39 Series 632	1'100'000	CHF	80.10 %	881'100.00	0.06
CH0330143188	0.02 % ZKB 16-27 Series 139	3'070'000	CHF	93.30 %	2'864'310.00	0.19
CH0330938835	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-38 Series 633	1'995'000	CHF	79.68 %	1'589'616.00	0.10
CH0331455334	0 % Kanton Basel-Stadt 16-26	1'370'000	CHF	95.50 %	1'308'350.00	0.08
CH0336352742	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-31 Series 635	1'960'000	CHF	88.00 %	1'724'800.00	0.11
CH0336352767	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-46 Series 637	800'000	CHF	72.84 %	582'720.00	0.04
CH0336587719	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-27 Series 483	11'730'000	CHF	94.36 %	11'068'428.00	0.72
CH0336587735	0.18 % Cembra Money Bank 16-23	620'000	CHF	99.98 %	619'876.00	0.04
CH0337645581	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-26 Series 485	2'220'000	CHF	95.00 %	2'109'000.00	0.14
CH0338330415	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-32 Series 639	2'350'000	CHF	86.07 %	2'022'645.00	0.13
CH0338330472	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-36 Series 641	5'585'000	CHF	81.55 %	4'554'567.50	0.29
CH0340953428	1/2 % BCV 16-28	1'615'000	CHF	93.30 %	1'506'795.00	0.10
CH0342587638	0.05 % ZKB 16-26 Series 140	1'960'000	CHF	94.60 %	1'854'160.00	0.12
CH0344583809	1/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-24 Series 486	4'570'000	CHF	98.03 %	4'479'971.00	0.29
CH0344583817	3/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-28 Series 487	1'300'000	CHF	93.32 %	1'213'160.00	0.08
CH0344958472	1/2 % Confederation Suisse 17-55	3'330'000	CHF	84.00 %	2'797'200.00	0.18
CH0344958498	1/2 % Confederation Suisse 17-45	15'875'000	CHF	88.12 %	13'989'050.00	0.90
CH0344958688	1/2 % Confederation Suisse 18-32	13'855'000	CHF	95.32 %	13'206'586.00	0.85
CH0347556927	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-37 Series 645	5'110'000	CHF	85.60 %	4'374'160.00	0.28
CH0352419615	5/8 % St Galler KB 17-32	820'000	CHF	89.95 %	737'590.00	0.05
CH0352595885	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-27 Series 489	4'300'000	CHF	94.80 %	4'076'400.00	0.26
CH0352595893	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 17-32 Series 490	5'860'000	CHF	89.91 %	5'268'726.00	0.34

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0353105197	3/8 % Thurgauer KB 17-28	1'430'000	CHF	93.80 %	1'341'340.00	0.09
CH0353428037	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-29 Series 646	4'750'000	CHF	92.62 %	4'399'450.00	0.28
CH0353574319	0.30 % Basler KB 17-27	490'000	CHF	94.50 %	463'050.00	0.03
CH0354836113	3/4 % Mobimo Holding 17-26	460'000	CHF	96.25 %	442'750.00	0.03
CH0357483160	2 % KW Linth-Limmern 17-23	2'750'000	CHF	99.95 %	2'748'625.00	0.18
CH0357676110	7/8 % Allreal Holding 17-27	490'000	CHF	95.00 %	465'500.00	0.03
CH0357676177	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 17-29 Series 493	3'460'000	CHF	92.72 %	3'208'112.00	0.21
CH0358654975	0.10 % Roche Kapitalmarkt 17-24 Tranche 2	1'630'000	CHF	98.37 %	1'603'431.00	0.10
CH0359915409	0.45 % Roche Kapitalmarkt 17-29 Tranche 3	820'000	CHF	93.10 %	763'420.00	0.05
CH0360677295	0.825 % Swiss Prime Site Finance 17-26	1'700'000	CHF	96.60 %	1'642'200.00	0.11
CH0361532820	1/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 17-27 Series 494	4'580'000	CHF	94.70 %	4'337'260.00	0.28
CH0361532895	0.15 % Partners Group Holding 17-24	3'360'000	CHF	98.70 %	3'316'320.00	0.21
CH0361532911	1/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 17-26 Series 495	3'910'000	CHF	96.20 %	3'761'420.00	0.24
CH0361532952	1 1/8 % Grande Dixence 17-24	2'970'000	CHF	99.17 %	2'945'349.00	0.19
CH0367206718	3/8 % Cembra Money Bank 17-25	2'740'000	CHF	96.90 %	2'655'060.00	0.17
CH0370943547	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-26 Series 651	4'475'000	CHF	95.54 %	4'275'415.00	0.28
CH0373476040	1/2 % Banque Cler 17-25	390'000	CHF	96.70 %	377'130.00	0.02
CH0373476339	0.30 % ZKB 18-28 Series 142	650'000	CHF	93.70 %	609'050.00	0.04
CH0373476412	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 18-28 Series 499	5'820'000	CHF	94.50 %	5'499'900.00	0.36
CH0373476420	0.65 % Centr. LdG Bques Cant. CH 18-33 Series 500	4'170'000	CHF	90.10 %	3'757'170.00	0.24
CH0373476776	1/8 % Graubuendner KB 18-24	1'830'000	CHF	98.84 %	1'808'772.00	0.12
CH0373476784	1/2 % Schaffhauser KB 18-28	720'000	CHF	93.95 %	676'440.00	0.04
CH0373476800	3/4 % Coop-Gruppe Genossenschaft 18-25	1'415'000	CHF	97.65 %	1'381'747.50	0.09
CH0373476966	3/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 18-33 Series 502	420'000	CHF	90.55 %	380'310.00	0.02
CH0379354225	1/4 % Aargauische KB 17-26	820'000	CHF	95.90 %	786'380.00	0.05
CH0384125073	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-30 Series 655	520'000	CHF	92.29 %	479'908.00	0.03
CH0391648018	1.55 % Nant de Drance 18-25	590'000	CHF	98.65 %	582'035.00	0.04
CH0397450724	1/4 % Basellandschaftliche KB 18-27	3'850'000	CHF	94.90 %	3'653'650.00	0.24
CH0398633229	1/2 % Zurich Compagnie d'Assurances 18-24 NT	2'480'000	CHF	98.30 %	2'437'840.00	0.16
CH0398633575	5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 18-29 Series 507	1'040'000	CHF	94.24 %	980'096.00	0.06
CH0398633799	0.15 % ZKB 19-27 Series 144	2'510'000	CHF	94.60 %	2'374'460.00	0.15
CH0398633807	0.70 % PSP Swiss Property 19-27 Reg S	390'000	CHF	95.20 %	371'280.00	0.02
CH0398633922	3/8 % Graubuendner KB 19-32	2'150'000	CHF	87.50 %	1'881'250.00	0.12
CH0399611307	0.35 % Luzerner KB 18-27	595'000	CHF	95.15 %	566'142.50	0.04
CH0405985836	0.70 % Thurgauer KB 18-30	2'770'000	CHF	92.75 %	2'569'175.00	0.17
CH0405986057	1/4 % Aargauische KB 18-25	1'930'000	CHF	97.55 %	1'882'715.00	0.12
CH0411478099	0.40 % BEKB 18-27	1'170'000	CHF	94.60 %	1'106'820.00	0.07
CH0413618353	0.70 % Kantonsspital Baden 18-28	1'400'000	CHF	94.20 %	1'318'800.00	0.09
CH0413618361	1.10 % Kantonsspital Baden 18-33	260'000	CHF	89.70 %	233'220.00	0.02
CH0419040800	0.41 % Luzerner KB 19-29	1'860'000	CHF	92.60 %	1'722'360.00	0.11
CH0419040842	0.55 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-31 Series 508	5'425'000	CHF	91.55 %	4'966'587.50	0.32
CH0419040891	1/2 % Kanton Basel-Stadt 19-34	1'300'000	CHF	88.65 %	1'152'450.00	0.07
CH0419040925	1.05 % Ville de Lausanne 19-44	1'340'000	CHF	85.50 %	1'145'700.00	0.07
CH0419040941	0.30 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-29 Series 509	8'350'000	CHF	92.55 %	7'727'925.00	0.50
CH0419040958	0.70 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-39 Series 510	965'000	CHF	84.95 %	819'767.50	0.05
CH0419040982	1/2 % Swisscom 19-29	520'000	CHF	93.30 %	485'160.00	0.03
CH0419040990	1 1/4 % Swiss Prime Site Finance 19-27	520'000	CHF	96.30 %	500'760.00	0.03
CH0419041006	0.15 % Basler KB 19-27	3'780'000	CHF	94.30 %	3'564'540.00	0.23

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0419041071	5/8 % Ville de Bienne 19-27	650'000	CHF	96.05 %	624'325.00	0.04
CH0419041188	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-34 Series 513	3'980'000	CHF	87.35 %	3'476'530.00	0.22
CH0419041238	1/8 % ZKB 19-29 Series 145	1'300'000	CHF	90.65 %	1'178'450.00	0.08
CH0419041337	0 % Valiant Bank 19-29	2'335'000	CHF	89.25 %	2'083'987.50	0.13
CH0419041352	0.285 % Cembra Money Bank 19-27	330'000	CHF	92.70 %	305'910.00	0.02
CH0419041378	5/8 % Aarekraftwerk Klingnau 19-29	420'000	CHF	91.50 %	384'300.00	0.02
CH0419041428	0 % Kantonsspital Winterthur 19-31	330'000	CHF	84.20 %	277'860.00	0.02
CH0419041436	0 % Aargauische KB 19-29	1'300'000	CHF	89.60 %	1'164'800.00	0.08
CH0419041469	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-37 Series 514	2'120'000	CHF	77.80 %	1'649'360.00	0.11
CH0419041485	0.10 % Berner KB 19-39	1'320'000	CHF	71.35 %	941'820.00	0.06
CH0419041584	0.10 % St.Galler KB 19-41	3'080'000	CHF	72.85 %	2'243'780.00	0.15
CH0419041675	0 % Banque Valiant 19-25	3'780'000	CHF	95.95 %	3'626'910.00	0.23
CH0419042509	3/4 % Nestle 18-28	1'730'000	CHF	95.60 %	1'653'880.00	0.11
CH0423233516	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-25 Series 659	3'290'000	CHF	96.85 %	3'186'365.00	0.21
CH0423233524	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-29 Series 660	2'380'000	CHF	93.70 %	2'230'060.00	0.14
CH0428194242	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-28 Series 661	3'330'000	CHF	93.75 %	3'121'875.00	0.20
CH0433761316	3/4 % Roche Kapitalmarkt 18-30	390'000	CHF	92.85 %	362'115.00	0.02
CH0434678394	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-28 Series 663	2'090'000	CHF	94.65 %	1'978'185.00	0.13
CH0437180935	3/4 % Swisscom 18-28	650'000	CHF	94.90 %	616'850.00	0.04
CH0438965581	1 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-47 Series 665	2'405'000	CHF	86.91 %	2'090'185.50	0.14
CH0440081393	0 % Confederation Suisse 19-34	14'710'000	CHF	88.89 %	13'075'719.00	0.85
CH0440081401	0 % Confederation Suisse 19-39	11'170'000	CHF	83.69 %	9'348'173.00	0.60
CH0440081567	1 1/2 % Confederation Suisse 22-38	9'130'000	CHF	105.20 %	9'604'760.00	0.62
CH0441186506	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-27 Series 666	3'590'000	CHF	95.25 %	3'419'475.00	0.22
CH0459297435	7/8 % UBS Group 19-25	2'600'000	CHF	99.14 %	2'577'640.00	0.17
CH0459810534	1/8 % Aargauische KB 19-26	4'080'000	CHF	96.00 %	3'916'800.00	0.25
CH0460054403	0.45 % Banca dello Stato del Cantone Ticino 19-29	835'000	CHF	92.15 %	769'452.50	0.05
CH0460054429	7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-43 Series 668	2'770'000	CHF	83.74 %	2'319'598.00	0.15
CH0461238963	0.10 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-31 Series 515	8'250'000	CHF	87.00 %	7'177'500.00	0.46
CH0461239029	1/8 % Banque Valiant 19-34	1'965'000	CHF	79.85 %	1'569'052.50	0.10
CH0461239045	0.05 % ZKB 20-31 Series 146	3'520'000	CHF	87.35 %	3'074'720.00	0.20
CH0461239086	0.05 % Basellandschaftliche KB 20-31	2'200'000	CHF	87.50 %	1'925'000.00	0.12
CH0471297926	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-30 Series 671	5'220'000	CHF	90.60 %	4'729'320.00	0.31
CH0474977698	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-29 Series 672	3'555'000	CHF	91.40 %	3'249'270.00	0.21
CH0474977730	0.80 % Grande Dixence 19-26	1'760'000	CHF	96.15 %	1'692'240.00	0.11
CH0482172399	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-41 Series 674	2'370'000	CHF	79.85 %	1'892'445.00	0.12
CH0483180938	0.05 % Banca dello Stato del Cantone Ticino 19-29	2'785'000	CHF	89.25 %	2'485'612.50	0.16
CH0484360380	1/4 % Kanton Zuerich 19-39	3'650'000	CHF	79.90 %	2'916'350.00	0.19
CH0485252800	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-27 Series 675	3'910'000	CHF	93.80 %	3'667'580.00	0.24
CH0485252818	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-34 Series 676	6'225'000	CHF	85.05 %	5'294'362.50	0.34
CH0485252826	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-44 Series 677	1'850'000	CHF	77.58 %	1'435'230.00	0.09
CH0485252875	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-49 Series 678	3'020'000	CHF	63.95 %	1'931'290.00	0.12
CH0485260902	0.10 % Banque Cantonale de Fribourg 19-44	2'100'000	CHF	66.95 %	1'405'950.00	0.09
CH0494734335	0 % Swisscom 19-44	330'000	CHF	66.05 %	217'965.00	0.01
CH0494734392	0 % Canton de Geneve 19-59	795'000	CHF	55.70 %	442'815.00	0.03
CH0496692978	0 % Baloise-Holding 19-26	390'000	CHF	94.50 %	368'550.00	0.02
CH0505011913	0 % Canton de Geneve 19-28	880'000	CHF	92.75 %	816'200.00	0.05
CH0506071114	0 % Banque Cantonale de Fribourg 20-30	880'000	CHF	88.50 %	778'800.00	0.05

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0506071163	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-31 Series 517	7'540'000	CHF	87.50 %	6'597'500.00	0.43
CH0506071171	0.02 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-40 Series 518	2'610'000	CHF	74.65 %	1'948'365.00	0.13
CH0506071221	0 % ZKB 20-30 Series 147	650'000	CHF	88.60 %	575'900.00	0.04
CH0506071270	0.14 % Banque Cantonale de Fribourg 20-30	2'575'000	CHF	88.70 %	2'284'025.00	0.15
CH0506071288	0.01 % Aargauische KB 20-28	1'680'000	CHF	92.25 %	1'549'800.00	0.10
CH0506071296	0 % Kanton Luzern 20-30	1'960'000	CHF	89.85 %	1'761'060.00	0.11
CH0506071338	1/8 % Luzerner KB 20-32	1'140'000	CHF	84.80 %	966'720.00	0.06
CH0508785752	1/4 % Stadt Zuerich 19-39	3'535'000	CHF	79.40 %	2'806'790.00	0.18
CH0511762061	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-27 Series 682	4'015'000	CHF	94.10 %	3'778'115.00	0.24
CH0515152467	0.13 % Swisscom 20-31	330'000	CHF	87.25 %	287'925.00	0.02
CH0515152483	0.405 % Raiffeisen Suisse 21-29 Series 3	1'100'000	CHF	88.85 %	977'350.00	0.06
CH0520663672	0.20 % Flughafen Zuerich 20-35	845'000	CHF	80.55 %	680'647.50	0.04
CH0522158895	0 % Kanton Luzern 21-31	1'110'000	CHF	88.40 %	981'240.00	0.06
CH0522158945	0.10 % Aargauische KB 21-30	980'000	CHF	87.90 %	861'420.00	0.06
CH0522158960	0.3126 % Banque Cantonale de Fribourg 22-32	1'730'000	CHF	87.25 %	1'509'425.00	0.10
CH0522158978	0.35 % St.Galler KB 22-31	1'300'000	CHF	88.60 %	1'151'800.00	0.07
CH0522159000	1 5/8 % Kanton Luzern 22-42	780'000	CHF	94.90 %	740'220.00	0.05
CH0522159034	1.70 % Basellandschaftliche KB 22-42	1'300'000	CHF	97.15 %	1'262'950.00	0.08
CH0522159042	1.60 % Basellandschaftliche KB 22-32	2'150'000	CHF	97.50 %	2'096'250.00	0.14
CH0522159091	1.40 % St Galler KB 22-30	2'640'000	CHF	96.90 %	2'558'160.00	0.17
CH0525158371	0.10 % Zurich Compagnie d'Assurances 20-32 NT	2'395'000	CHF	84.00 %	2'011'800.00	0.13
CH0525158397	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-28 Series 683	2'930'000	CHF	92.65 %	2'714'645.00	0.18
CH0525158413	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-45 Series 684	1'765'000	CHF	67.72 %	1'195'258.00	0.08
CH0528881169	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-30 Series 685	9'395'000	CHF	89.30 %	8'389'735.00	0.54
CH0528881201	1/4 % Canton de Geneve 20-28	330'000	CHF	94.05 %	310'365.00	0.02
CH0536892588	0.95 % SGS 20-26	1'675'000	CHF	96.65 %	1'618'887.50	0.10
CH0536892612	0.70 % Flughafen Zuerich 20-24	2'330'000	CHF	99.19 %	2'311'127.00	0.15
CH0536892620	1 % Firmenich International 20-23	4'695'000	CHF	99.74 %	4'682'793.00	0.30
CH0536892737	0 % Kanton Zuerich 20-28	650'000	CHF	93.20 %	605'800.00	0.04
CH0536892745	0.10 % Kanton Zuerich 20-45	2'355'000	CHF	70.90 %	1'669'695.00	0.11
CH0536892901	0.20 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-35 Series 523	8'870'000	CHF	82.75 %	7'339'925.00	0.47
CH0536893339	0.15 % Swissgrid 20-34	2'450'000	CHF	79.95 %	1'958'775.00	0.13
CH0536893412	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-30 Series 526	8'820'000	CHF	88.65 %	7'818'930.00	0.51
CH0537261924	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-27 Series 686	1'960'000	CHF	94.00 %	1'842'400.00	0.12
CH0537261932	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-40 Series 687	650'000	CHF	80.85 %	525'525.00	0.03
CH0539032950	7/8 % Adecco Group 20-25 NT	650'000	CHF	97.40 %	633'100.00	0.04
CH0543827205	1 1/4 % Nant de Drance 20-27	2'670'000	CHF	96.30 %	2'571'210.00	0.17
CH0545754688	1/8 % Basler KB 20-32	1'700'000	CHF	85.50 %	1'453'500.00	0.09
CH0547243235	0.05 % Canton de Geneve 20-29	2'410'000	CHF	90.85 %	2'189'485.00	0.14
CH0550413386	0.60 % Ville de Lausanne 20-50	2'020'000	CHF	71.95 %	1'453'390.00	0.09
CH0553331809	1.05 % Ferring Holding 20-25	1'870'000	CHF	97.60 %	1'825'120.00	0.12
CH0553331817	1/4 % Baloise-Holding 20-26	780'000	CHF	94.90 %	740'220.00	0.05
CH0553331858	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-30 Series 690	5'670'000	CHF	89.45 %	5'071'815.00	0.33
CH0553331866	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-41 Series 691	3'680'000	CHF	76.41 %	2'811'888.00	0.18
CH0557778310	1/4 % Confederation Suisse 21-35	12'555'000	CHF	90.61 %	11'376'085.50	0.74
CH0561923845	0.80 % Sulzer 20-25	1'285'000	CHF	97.15 %	1'248'377.50	0.08
CH0561923878	0 % Stadt Zuerich 20-60	1'625'000	CHF	55.10 %	895'375.00	0.06
CH0564642046	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-40 Series 692	3'330'000	CHF	75.30 %	2'507'490.00	0.16

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0564642053	0.07 % Credit Agricole next bank (Suisse) 20-29	1'440'000	CHF	89.00 %	1'281'600.00	0.08
CH0564642079	0.01 % Lindt & Spruengli 20-28	1'680'000	CHF	91.00 %	1'528'800.00	0.10
CH0565650832	1/4 % Basellandschaftliche KB 20-32	1'850'000	CHF	86.30 %	1'596'550.00	0.10
CH0568056219	0.14 % Stadt St Gallen 20-44	330'000	CHF	70.45 %	232'485.00	0.02
CH0569237669	0.20 % Canton de Geneve 20-35	1'975'000	CHF	83.40 %	1'647'150.00	0.11
CH0570576113	7/8 % Nant de Drance 20-29	2'485'000	CHF	92.50 %	2'298'625.00	0.15
CH0570576121	0.05 % ZKB 20-32 Series 148	1'240'000	CHF	84.20 %	1'044'080.00	0.07
CH0570576154	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-30 Series 528	260'000	CHF	89.21 %	231'946.00	0.01
CH0570576279	1/8 % Swissgrid 20-36	250'000	CHF	75.25 %	188'125.00	0.01
CH0572899257	1/2 % Raiffeisen Suisse 20-28	3'100'000	CHF	91.10 %	2'824'100.00	0.18
CH0575017071	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-29 Series 695	6'420'000	CHF	89.85 %	5'768'370.00	0.37
CH0575017089	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-32 Series 696	6'110'000	CHF	85.80 %	5'242'380.00	0.34
CH0581947816	3/8 % Swiss Prime Site Finance 21-28	705'000	CHF	91.75 %	646'837.50	0.04
CH0589030946	0 % ZKB 21-33 Series 149	3'230'000	CHF	83.55 %	2'698'665.00	0.17
CH0589031019	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-29 Series 529	5'930'000	CHF	91.10 %	5'402'230.00	0.35
CH0589031035	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-36 Series 531	2'280'000	CHF	79.75 %	1'818'300.00	0.12
CH0591084253	0.57 % Raiffeisen Suisse 21-31 Series 2	1'900'000	CHF	87.55 %	1'663'450.00	0.11
CH0591979619	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-41 Series 697	245'000	CHF	72.50 %	177'625.00	0.01
CH0598928718	3/8 % UBS Group 21-29 NT	1'600'000	CHF	88.90 %	1'422'400.00	0.09
CH1100259758	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-31 Series 700	5'020'000	CHF	88.50 %	4'442'700.00	0.29
CH1101096464	0.10 % ZKB 21-31 Series 150	1'500'000	CHF	87.55 %	1'313'250.00	0.08
CH1101096522	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-28 Series 534	4'240'000	CHF	92.70 %	3'930'480.00	0.25
CH1101096621	0 % Kanton Zuerich 21-33	1'210'000	CHF	85.20 %	1'030'920.00	0.07
CH1105672690	0.30 % Grande Dixence 21-28	260'000	CHF	90.85 %	236'210.00	0.02
CH1111392853	0 % Kanton Bern 21-33	1'300'000	CHF	85.15 %	1'106'950.00	0.07
CH1112455766	1/4 % Swisscom 21-33	1'110'000	CHF	85.55 %	949'605.00	0.06
CH1118223408	0.15 % Stiftung Kantonsspital Graubuenden 21-30	850'000	CHF	87.65 %	745'025.00	0.05
CH1118223424	0.10 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-32 Series 537	2'510'000	CHF	86.20 %	2'163'620.00	0.14
CH1118223481	0.05 % Kantonsspital St. Gallen 21-31	1'300'000	CHF	83.55 %	1'086'150.00	0.07
CH1118223499	0.30 % Kantonsspital St. Gallen 21-36	1'140'000	CHF	77.05 %	878'370.00	0.06
CH1122290187	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-27 Series 704	2'670'000	CHF	93.04 %	2'484'168.00	0.16
CH1129053794	1/8 % BCV 21-33	720'000	CHF	82.70 %	595'440.00	0.04
CH1129053828	0.20 % Swissgrid 21-40	260'000	CHF	69.85 %	181'610.00	0.01
CH1130818839	1/8 % Baloise-Holding 21-30	520'000	CHF	87.75 %	456'300.00	0.03
CH1131931243	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-31 Series 538	6'100'000	CHF	86.95 %	5'303'950.00	0.34
CH1131931276	0 % Kantonsspital Winterthur 21-25	1'110'000	CHF	95.80 %	1'063'380.00	0.07
CH1131931292	0 % Swissgrid 21-26	885'000	CHF	94.90 %	839'865.00	0.05
CH1131931318	0.20 % WWZ 21-33	200'000	CHF	82.50 %	165'000.00	0.01
CH1131931409	0.30 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-36 Series 540	3'550'000	CHF	82.10 %	2'914'550.00	0.19
CH1132966339	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-36 Series 707	4'730'000	CHF	82.35 %	3'895'155.00	0.25
CH1132966354	1/8 % Inselspital-Stiftung 21-29	2'870'000	CHF	88.60 %	2'542'820.00	0.16
CH1137122755	0.05 % Tecan Group 21-25	2'235'000	CHF	96.10 %	2'147'835.00	0.14
CH1141700430	1/4 % Stadt Zuerich 21-51	780'000	CHF	68.40 %	533'520.00	0.03
CH1141700463	0.20 % Kanton Bern 21-36	2'090'000	CHF	81.90 %	1'711'710.00	0.11
CH1145096165	0.435 % UBS Group 21-28	1'800'000	CHF	91.05 %	1'638'900.00	0.11
CH1148266161	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-28 Series 709	3'360'000	CHF	92.10 %	3'094'560.00	0.20
CH1148728046	0.10 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-31 Series 541	6'650'000	CHF	87.98 %	5'850'670.00	0.38
CH1148728111	0.20 % ZKB 22-30	650'000	CHF	89.20 %	579'800.00	0.04



ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1148728178	3/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-32 Series 542	4'830'000	CHF	87.86 %	4'243'638.00	0.27
CH1148728269	0.65 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-31 Series 545	2'480'000	CHF	91.42 %	2'267'216.00	0.15
CH1148728277	3/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-37 Series 546	1'300'000	CHF	87.35 %	1'135'550.00	0.07
CH1151526154	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-31 Series 710	3'390'000	CHF	87.30 %	2'959'470.00	0.19
CH1151526196	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-37 Series 712	2'150'000	CHF	82.60 %	1'775'900.00	0.11
CH1160382896	0.22 % Credit Agricole next bank (Suisse) 22-28	3'460'000	CHF	91.80 %	3'176'280.00	0.21
CH1166151907	3/4 % Roche Kapitalmarkt 22-31	2'800'000	CHF	92.35 %	2'585'800.00	0.17
CH1166151949	3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-35 Series 715	5'670'000	CHF	88.55 %	5'020'785.00	0.32
CH1170565621	1/4 % ZKB 22-28 Series 154	1'860'000	CHF	93.15 %	1'732'590.00	0.11
CH1170565662	0.90 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-33 Series 548	2'610'000	CHF	91.95 %	2'399'895.00	0.16
CH1170565670	1 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-37 Series 549	820'000	CHF	89.90 %	737'180.00	0.05
CH1170565720	1.30 % Banque Cantonale de Neuchatel 22-32	330'000	CHF	93.90 %	309'870.00	0.02
CH1170565803	1.40 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-32 Series 551	7'530'000	CHF	96.50 %	7'266'450.00	0.47
CH1170565811	1.45 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-42 Series 552	2'610'000	CHF	94.06 %	2'454'966.00	0.16
CH1174335781	1 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-30 Series 716	5'540'000	CHF	94.85 %	5'254'690.00	0.34
CH1177791840	3/4 % Stadt Zuerich 22-31	1'300'000	CHF	93.60 %	1'216'800.00	0.08
CH1179534966	1.70 % Grande Dixence 22-29	1'570'000	CHF	96.85 %	1'520'545.00	0.10
CH1179535013	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-32 Series 718	5'870'000	CHF	96.60 %	5'670'420.00	0.37
CH1179535021	1 5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-38 Series 719	4'120'000	CHF	97.35 %	4'010'820.00	0.26
CH1182086848	1.65 % Kantonsspital Aarau 22-37	1'060'000	CHF	91.45 %	969'370.00	0.06
CH1189217719	1.30 % % Graubuendner KB 22-30	2'770'000	CHF	96.35 %	2'668'895.00	0.17
CH1189217768	1.70 % Kantonsspital Baselland 22-32	2'090'000	CHF	95.15 %	1'988'635.00	0.13
CH1189217784	1.10 % Swissgrid 22-27	1'715'000	CHF	97.60 %	1'673'840.00	0.11
CH1189217826	1 1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-29 Series 553	6'130'000	CHF	98.36 %	6'029'468.00	0.39
CH1189217834	1.70 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-32 Series 554	4'990'000	CHF	99.00 %	4'940'100.00	0.32
CH1189217842	1.90 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-42 Series 555	3'030'000	CHF	101.05 %	3'061'815.00	0.20
CH1189217909	1.65 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-32 Series 557	5'220'000	CHF	98.55 %	5'144'310.00	0.33
CH1189217917	1.80 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-36 Series 558	3'680'000	CHF	99.55 %	3'663'440.00	0.24
CH1189217925	1.40 % ZKB 22-29	650'000	CHF	97.55 %	634'075.00	0.04
CH1191066187	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-33 Series 720	6'330'000	CHF	97.10 %	6'146'430.00	0.40
CH1191066237	1 1/2 % Stadt Zuerich 22-52	980'000	CHF	95.40 %	934'920.00	0.06
CH1193213027	1 1/2 % Kanton Basel-Stadt 22-28	650'000	CHF	99.70 %	648'050.00	0.04
CH1193213076	1 3/4 % Basler KB 22-29 Series 1	2'610'000	CHF	99.50 %	2'596'950.00	0.17
CH1193213142	2.10 % Basler KB 23-33	3'260'000	CHF	101.60 %	3'312'160.00	0.21
CH1194355066	2 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-37 Series 722	3'260'000	CHF	106.20 %	3'462'120.00	0.22
CH1194355074	2 1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-52 Series 723	1'630'000	CHF	110.85 %	1'806'855.00	0.12
CH1194355116	2 1/8 % Nestle 22-30	750'000	CHF	101.90 %	764'250.00	0.05
CH1194355124	2 1/2 % Nestle 22-34	1'960'000	CHF	105.65 %	2'070'740.00	0.13
CH1196217017	2 5/8 % Romande Energie Holding 22-37	4'150'000	CHF	104.65 %	4'342'975.00	0.28
CH1199659975	1 7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-38 Series 725	3'260'000	CHF	100.55 %	3'277'930.00	0.21
CH1204259738	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-32 Series 726	2'150'000	CHF	96.50 %	2'074'750.00	0.13
CH1204259746	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-42 Series 727	4'400'000	CHF	94.52 %	4'158'880.00	0.27
CH1206367422	1.85 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-37 Series 560	6'910'000	CHF	100.45 %	6'941'095.00	0.45
CH1206367463	1.95 % Groupe E 22-27	850'000	CHF	99.05 %	841'925.00	0.05
CH1206367471	2.55 % Groupe E 22-32	980'000	CHF	101.15 %	991'270.00	0.06
CH1206367497	3 3/4 % dormakaba Finance 22-27	1'570'000	CHF	103.90 %	1'631'230.00	0.11
CH1206367596	2.35 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-37 Series 565	2'960'000	CHF	106.65 %	3'156'840.00	0.20
CH1206367638	1.85 % ZKB 22-27 Series 157	4'600'000	CHF	100.00 %	4'600'000.00	0.30

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1206367679	1.45 % Kanton Zuerich 22-29	1'920'000	CHF	99.50 %	1'910'400.00	0.12
CH1209697551	1 1/4 % Thurgauer KB 22-29	2'320'000	CHF	96.40 %	2'236'480.00	0.14
CH1211713156	1.6075 % Credit Agricole next bank (Suisse) 22-27	1'300'000	CHF	98.55 %	1'281'150.00	0.08
CH1211713164	1.97 % Credit Agricole next bank (Suisse) 22-32	2'280'000	CHF	98.45 %	2'244'660.00	0.15
CH1214797131	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 33-34 Series 728	650'000	CHF	101.75 %	661'375.00	0.04
CH1214912029	2.05 % Luzerner KB 22-47	2'020'000	CHF	103.60 %	2'092'720.00	0.14
CH1217066583	1 7/8 % Basler KB 23-29	1'400'000	CHF	100.00 %	1'400'000.00	0.09
CH1217066591	2 % Basler KB 23-34	1'500'000	CHF	100.60 %	1'509'000.00	0.10
CH1218301955	2 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-32 Series 730	3'420'000	CHF	102.50 %	3'505'500.00	0.23
CH1218301963	2 1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-37 Series 731	2'935'000	CHF	104.75 %	3'074'412.50	0.20
CH1226543838	2 1/4 % Nestle 22-29	1'370'000	CHF	102.50 %	1'404'250.00	0.09
CH1226543846	2 5/8 % Nestle 22-35	1'450'000	CHF	107.35 %	1'556'575.00	0.10
CH1230759560	1.95 % Inselspital-Stiftung 23-26	3'160'000	CHF	99.45 %	3'142'620.00	0.20
CH1231094355	2 1/8 % Luzerner KB 23-32	2'800'000	CHF	101.60 %	2'844'800.00	0.18
CH1231094371	1.70 % Stadt Bern 23-33	980'000	CHF	99.60 %	976'080.00	0.06
CH1231094389	1.90 % Luzerner KB 23-31	2'930'000	CHF	100.15 %	2'934'395.00	0.19
CH1231094397	2 % Luzerner KB 23-38	3'260'000	CHF	101.20 %	3'299'120.00	0.21
CH1232107024	1 1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-27 Series 566	1'300'000	CHF	99.10 %	1'288'300.00	0.08
CH1232107032	1.70 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-30 Series 567	2'610'000	CHF	99.32 %	2'592'252.00	0.17
CH1232107131	2.05 % BCV 23-28	3'360'000	CHF	100.70 %	3'383'520.00	0.22
CH1239464550	1.90 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-38 Series 569	3'650'000	CHF	101.00 %	3'686'500.00	0.24
CH1239464568	2.10 % Ville de Lausanne 23-48	1'300'000	CHF	103.50 %	1'345'500.00	0.09
CH1239464634	2 1/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-38 Series 570	2'280'000	CHF	103.90 %	2'368'920.00	0.15
CH1239464667	2.20 % Stadt Winterthur 23-58	910'000	CHF	111.10 %	1'011'010.00	0.07
CH1239464691	3 % Allreal Holding 23-28	1'370'000	CHF	102.50 %	1'404'250.00	0.09
CH1239464725	2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-29 Series 571	3'260'000	CHF	101.39 %	3'305'314.00	0.21
CH1239464733	2.05 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-32 Series 572	3'260'000	CHF	101.80 %	3'318'680.00	0.21
CH1239464782	2.05 % Banque Cantonale de Neuchatel 23-28	490'000	CHF	100.30 %	491'470.00	0.03
CH1239464790	2.05 % Banca dello Stato del Cantone Ticino 23-30	1'470'000	CHF	100.50 %	1'477'350.00	0.10
CH1239494987	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-29 Series 732	3'910'000	CHF	99.89 %	3'905'699.00	0.25
CH1239494995	1 7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-33 Series 733	3'720'000	CHF	100.60 %	3'742'320.00	0.24
CH1243651903	2.4113 % Cembra Money Bank 23-29	1'890'000	CHF	100.55 %	1'900'395.00	0.12
CH1243651945	2 3/4 % Kraftwerke Linth-Limmern 23-30	1'355'000	CHF	102.40 %	1'387'520.00	0.09
CH1243651952	1 7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-31 series 734	4'240'000	CHF	100.636 %	4'266'966.40	0.28
CH1249416038	2 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-26 Series 735	3'910'000	CHF	101.00 %	3'949'100.00	0.26
CH1255924404	2.70 % Ferring Holding 23-27	7'110'000	CHF	100.40 %	7'138'440.00	0.46
CH1255924412	3 1/4 % Ferring Holding 23-31	3'900'000	CHF	101.70 %	3'966'300.00	0.26
CH1255924420	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-33 Series 738	1'960'000	CHF	101.60 %	1'991'360.00	0.13
CH1255924438	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-38 Series 739	6'420'000	CHF	102.55 %	6'583'710.00	0.43
CH1266847073	2.55 % Kantonsspital Baden 23-38	1'430'000	CHF	101.55 %	1'452'165.00	0.09
CH1266847107	1.70 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-28 Series 574	1'630'000	CHF	99.75 %	1'625'925.00	0.11
CH1266847156	1.90 % Swissgrid 23-26	650'000	CHF	100.25 %	651'625.00	0.04
CH1266847172	2.40 % KEBAG 23-38	980'000	CHF	101.75 %	997'150.00	0.06
CH1266847214	1.85 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-31 Series 575	3'260'000	CHF	100.70 %	3'282'820.00	0.21
CH1266847255	1.80 % Banque Cantonale du Valais 23-29	2'610'000	CHF	99.65 %	2'600'865.00	0.17
CH1266847271	1.85 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-33 Series 578	3'260'000	CHF	100.35 %	3'271'410.00	0.21
CH1266847289	1.85 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-38 Series 579	3'910'000	CHF	100.56 %	3'931'896.00	0.25
CH1267329279	2.10 % BCV 23-32	2'930'000	CHF	100.60 %	2'947'580.00	0.19

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1268922205	2 7/8 % OC Oerlikon Corporation 23-26	1'960'000	CHF	100.10 %	1'961'960.00	0.13
CH1270609485	1.85 % Valiant 28 23-28	3'260'000	CHF	99.65 %	3'248'590.00	0.21
CH1273475397	1 7/8 % Nestle 23-29	1'040'000	CHF	100.40 %	1'044'160.00	0.07
CH1273475405	2 % Nestle 23-33	1'960'000	CHF	101.00 %	1'979'600.00	0.13
CH1273475413	2 1/8 % Nestle 23-38	1'470'000	CHF	102.15 %	1'501'605.00	0.10
CH1274703110	1.8984 % Credit Agricole next bank (Suisse) 23-26	650'000	CHF	99.95 %	649'675.00	0.04
CH1276313256	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-40 Series 740	6'520'000	CHF	102.25 %	6'666'700.00	0.43
CH1276313314	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-33 Series 742	4'570'000	CHF	99.45 %	4'544'865.00	0.29
CH1276313322	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-38 Series 743	3'260'000	CHF	98.70 %	3'217'620.00	0.21
CH1279261163	1.70 % Stadt Zuerich 23-44	2'540'000	CHF	100.50 %	2'552'700.00	0.17
CH1280154290	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-43 Series 744	3'550'000	CHF	99.66 %	3'537'930.00	0.23
CH1280154308	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-33 Series 745	2'000'000	CHF	99.38 %	1'987'600.00	0.13
CH1280155461	1.80 % St Galler KB 23-33	1'960'000	CHF	98.50 %	1'930'600.00	0.12
CH1289657111	2 % Emmi Finanz 23-28	2'000'000	CHF	100.25 %	2'005'000.00	0.13
CH1290222285	2 3/8 % Bank Julius Baer & Co, Guernsey Branch 23-27	1'300'000	CHF	100.70 %	1'309'100.00	0.08
CH1290222301	2.40 % Kantonsspital St. Gallen 23-33	2'860'000	CHF	101.20 %	2'894'320.00	0.19
CH1290222319	2 1/2 % Kantonsspital St. Gallen 23-38	3'780'000	CHF	100.80 %	3'810'240.00	0.25
CH1290222418	1 3/4 % Stadt Zuerich 23-41	2'150'000	CHF	100.78 %	2'166'770.00	0.14
CH1290975528	1.90 % Banque Cantonale de Fribourg 23-26	2'610'000	CHF	100.15 %	2'613'915.00	0.17
CH1293237975	1.965 % ABB 23-26	910'000	CHF	100.10 %	910'910.00	0.06
CH1293714346	2 1/4 % Partners Group 23-28	1'500'000	CHF	100.40 %	1'506'000.00	0.10
CH1293714361	2 3/8 % Inselspital-Stiftung 23-31	1'960'000	CHF	100.70 %	1'973'720.00	0.13
CH1293714379	2.52 % Inselspital-Stiftung 23-38	1'000'000	CHF	100.30 %	1'003'000.00	0.06
<b>Suisse</b>					<b>1'153'140'961.40</b>	<b>74.53</b>
CH0471298007	0.40 % Banco de Credito e Inversiones 19-24 NT	260'000	CHF	97.71 %	254'046.00	0.02
CH1112011601	0.33 % Banco Santander Chile 21-27 NT	2'595'000	CHF	91.50 %	2'374'424.99	0.15
CH1248666963	2.8925 % Banco de Credito e Inversiones 23-28 NT	1'300'000	CHF	100.05 %	1'300'650.00	0.08
<b>Chili</b>					<b>3'929'120.99</b>	<b>0.25</b>
CH0520663664	1/2 % Banco Mercantile Del Norte 20-24	390'000	CHF	96.50 %	376'350.00	0.02
<b>Caïmans (îles)</b>					<b>376'350.00</b>	<b>0.02</b>
CH0235834154	1 1/2 % Deutsche Bahn Finance 14-24	2'120'000	CHF	99.67 %	2'113'004.00	0.14
CH0479514272	0.10 % Deutsche Bahn Finance 19-29 NT Guaranteed	260'000	CHF	90.75 %	235'950.00	0.02
CH0481013768	0.20 % Muenchener Hypothekenbank 19-31	460'000	CHF	87.55 %	402'730.00	0.03
CH0517825334	0.10 % Muenchener Hypothekenbank 20-25	4'200'000	CHF	95.00 %	3'990'000.00	0.26
CH0522158887	0.20 % Deutsche Bahn Finance 21-33 NT	1'170'000	CHF	85.20 %	996'840.00	0.06
CH0561923837	1/4 % Muenchener Hypothekenbank 20-28	2'450'000	CHF	90.50 %	2'217'250.00	0.14
CH1122290237	0.05 % Muenchener Hypothekenbank 21-36	3'000'000	CHF	78.60 %	2'358'000.00	0.15
CH1137122797	1/4 % Deutsche Bahn Finance 21-31	1'300'000	CHF	87.90 %	1'142'700.00	0.07
CH1139995810	0.01 % Muenchener Hypothekenbank 21-26	1'300'000	CHF	94.50 %	1'228'500.00	0.08
CH1163572915	3/8 % Berlin Hyp 22-25	650'000	CHF	97.70 %	635'050.00	0.04
CH1195555409	1 1/4 % Muenchener Hypothekenbank 22-27	3'260'000	CHF	97.75 %	3'186'650.00	0.21
CH1202242249	0.9675 % Berlin Hyp 22-26	1'630'000	CHF	97.55 %	1'590'065.00	0.10
CH1204259811	1.95 % Deutsche Bahn Finance 22-32 NT	1'810'000	CHF	100.65 %	1'821'765.00	0.12
CH1227937708	2.5025 % E.ON 22-29	720'000	CHF	101.55 %	731'160.00	0.05

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1228838129	2.285 % Deutsche Bahn Finance 22-42 NT	1'300'000	CHF	104.80 %	1'362'400.00	0.09
CH1233900005	1 7/8 % Muenchener Hypothekenbank 23-30	4'570'000	CHF	99.75 %	4'558'575.00	0.29
CH1244731753	2 5/8 % DZ BANK AG 23-29	2'200'000	CHF	99.15 %	2'181'300.00	0.14
CH1244731795	2 1/8 % Berlin Hyp 23-26	3'550'000	CHF	100.05 %	3'551'775.00	0.23
CH1245295758	3.2625 % Commerzbank 23-27 NT	2'800'000	CHF	100.60 %	2'816'800.00	0.18
CH1261608900	2.8325 % DZ BANK AG 23-29	1'000'000	CHF	100.55 %	1'005'500.00	0.06
CH1264414322	3.80 % Commerzbank 23-28 NT	2'600'000	CHF	102.05 %	2'653'300.00	0.17
CH1271360609	1.6275 % NRW Bank 23-28 NT	3'260'000	CHF	100.40 %	3'273'040.00	0.21
CH1277080508	1.885 % Deutsche Bahn Finance 23-35	2'500'000	CHF	99.45 %	2'486'250.00	0.16
CH1293238007	2.2025 % DZ BANK 23-28	1'630'000	CHF	99.85 %	1'627'555.00	0.11
<b>Allemagne</b>					<b>48'166'159.00</b>	<b>3.11</b>
CH0026985520	2 7/8 % Kommunekredit 06-31 NT	1'630'000	CHF	108.45 %	1'767'735.00	0.11
CH0285597370	5/8 % Kommunekredit 15-27 NT	360'000	CHF	96.30 %	346'680.00	0.02
CH1227937732	1 5/8 % Kommunekredit 23-30 NT	4'130'000	CHF	100.20 %	4'138'260.00	0.27
<b>Danemark</b>					<b>6'252'675.00</b>	<b>0.40</b>
CH0505011947	0.20 % Banco Santander 19-27	475'000	CHF	91.70 %	435'575.00	0.03
CH0522690707	1/8 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 20-26 NT	1'600'000	CHF	93.75 %	1'500'000.00	0.10
CH1112011577	0.31 % Banco Santander 21-28 Tranche 1	330'000	CHF	90.75 %	299'475.00	0.02
CH1112011593	0.477 % CAIXABANK 21-27 Tranche 1 NT	2'000'000	CHF	93.00 %	1'860'000.00	0.12
CH1184694763	1.3275 % Banco Santander 22-25 NT	1'430'000	CHF	98.50 %	1'408'550.00	0.09
CH1227937724	2.2475 % Banco Santander 23-26 Series 176 NT	2'090'000	CHF	100.00 %	2'090'000.00	0.13
CH1228837899	2.4075 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 22-25 NT	1'400'000	CHF	100.35 %	1'404'900.00	0.09
CH1228837907	2.77 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 22-28	1'200'000	CHF	101.45 %	1'217'400.00	0.08
CH1276269755	2.7325 % Santander Consumer Finance 23-25 NT	1'700'000	CHF	100.75 %	1'712'750.00	0.11
<b>Espagne</b>					<b>11'928'650.00</b>	<b>0.77</b>
CH0185907083	1 3/8 % Municipality Finance 12-27 NT	200'000	CHF	99.05 %	198'100.00	0.01
CH0251885791	3/4 % Municipality Finance 14-24	1'430'000	CHF	99.00 %	1'415'700.00	0.09
CH0284415681	0.55 % Nordea Bank 15-25 NT	1'730'000	CHF	97.80 %	1'691'940.00	0.11
CH0361533125	5/8 % Municipality Finance 17-38	390'000	CHF	84.85 %	330'915.00	0.02
CH1194000316	1.81 % Nordea Bank 22-27 NT	200'000	CHF	97.70 %	195'400.00	0.01
CH1244321779	1 5/8 % Municipality Finance 23-28 NT	2'930'000	CHF	100.25 %	2'937'325.00	0.20
CH1244321803	1 1/2 % Nordic Investment Bank 23-28 NT	2'610'000	CHF	100.10 %	2'612'610.00	0.17
CH1264823514	2.49 % Nordea Bank 23-28 NT	800'000	CHF	100.10 %	800'800.00	0.05
<b>Finlande</b>					<b>10'182'790.00</b>	<b>0.66</b>
CH0024141100	2 1/2 % CFF 06-31 NT	230'000	CHF	103.90 %	238'970.00	0.02
CH0118886735	2 % SNCF Reseau 10-26 NT	1'300'000	CHF	100.60 %	1'307'800.00	0.08
CH0212937244	1 3/4 % CRH 13-25	1'960'000	CHF	99.80 %	1'956'080.00	0.13
CH0368825474	0.40 % Banque Federative du Credit Mutuel 17-25 NT	1'630'000	CHF	96.25 %	1'568'875.00	0.10
CH0386949348	0.30 % Caisse des Depots et Consignations 17-27 NT	1'400'000	CHF	94.10 %	1'317'400.00	0.09
CH0414510062	1/4 % Caisse des Depots et Consignations 18-25	800'000	CHF	97.40 %	779'200.00	0.05
CH0435590382	1/2 % Credit Agricole 18-28	1'990'000	CHF	93.35 %	1'857'665.00	0.12
CH0463112075	7/8 % Societe Generale 19-24 NT	2'200'000	CHF	99.47 %	2'188'340.00	0.14
CH0479514264	0.20 % Banque Federative du Credit Mutuel 19-26 NT	520'000	CHF	94.85 %	493'220.00	0.03

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0506071205	0.15 % BNP Paribas 20-28 NT	2'600'000	CHF	90.80 %	2'360'800.00	0.15
CH0521617339	1/4 % Societe Generale 20-27 NT	1'600'000	CHF	92.45 %	1'479'200.00	0.10
CH0550413345	0.227 % SNCF 20-30 NT	1'370'000	CHF	89.95 %	1'232'315.00	0.08
CH1142512347	0.5275 % BNP Paribas 22-28 NT	1'600'000	CHF	92.25 %	1'476'000.00	0.10
CH1142512362	2.8925 % BNP Paribas 22-29 NT	1'200'000	CHF	101.30 %	1'215'600.00	0.08
CH1179184416	0.89 % Compagnie de Financement Foncier 22-29	3'650'000	CHF	95.00 %	3'467'500.00	0.22
CH1187450817	1 1/2 % Banque Federative du Credit Mutuel 22-27	1'470'000	CHF	97.25 %	1'429'575.00	0.09
CH1187520460	1.4604 % Credit Agricole 22-27 NT	1'300'000	CHF	97.10 %	1'262'300.00	0.08
CH1213243913	3.0425 % Credit Agricole 22-27 NT	1'200'000	CHF	102.30 %	1'227'600.00	0.08
CH1227937716	2.4125 % BNP Paribas 23-28 NT	3'800'000	CHF	100.45 %	3'817'100.00	0.25
CH1231312674	1 3/4 % Caisse des Depots et Consignations 22-29 NT	1'800'000	CHF	99.60 %	1'792'800.00	0.12
CH1242969199	2.30 % Banque Federative du Credit Mutuel 23-27 NT	1'080'000	CHF	100.25 %	1'082'700.00	0.07
CH1244321761	2.63 % BNP Paribas 23-29 NT	1'000'000	CHF	101.30 %	1'013'000.00	0.07
CH1248666955	2.6175 % Societe Generale 23-30 NT	1'470'000	CHF	100.70 %	1'480'290.00	0.10
CH1249151049	1 3/4 % Caisse des Depots et Consignations 23-31 NT	3'600'000	CHF	99.35 %	3'576'600.00	0.23
CH1249416004	2.5413 % Credit Agricole 23-30	1'500'000	CHF	101.05 %	1'515'750.00	0.10
CH1251030107	1.903 % Compagnie de Financement Foncier 23-28	3'230'000	CHF	100.30 %	3'239'690.00	0.21
CH1256367207	2.5075 % Credit Agricole 23-27 NT	1'630'000	CHF	100.85 %	1'643'855.00	0.11
CH1268922189	1.825 % Credit Agricole Home Loan SFH 23-28	3'390'000	CHF	99.70 %	3'379'830.00	0.22
CH1271360567	1 5/8 % Credit Agricole next bank (Suisse) 22-29	3'260'000	CHF	100.45 %	3'274'670.00	0.21
CH1276269730	2.73 % Banque Federative du Credit Mutuel 23-30 NT	3'250'000	CHF	101.90 %	3'311'750.00	0.21
CH1277028440	1.985 % SNCF 23-33 NT	1'700'000	CHF	100.60 %	1'710'200.00	0.11
CH1277240938	2.7725 % La Banque Postale 23-27 NT	3'300'000	CHF	101.85 %	3'361'049.99	0.22
CH1277582008	2.34 % ENGIE 23-27 NT	2'470'000	CHF	100.90 %	2'492'230.00	0.16
CH1279261148	1.8375 % CFF 23-30 NT	4'570'000	CHF	99.80 %	4'560'860.00	0.27
CH1294486357	2.3625 % Credit Agricole 23-28 NT	1'500'000	CHF	100.33 %	1'504'950.00	0.10
<b>France</b>					<b>69'615'764.99</b>	<b>4.50</b>
CH0370634666	5/8 % Credit Agricole 17-24 NT	650'000	CHF	98.90 %	642'850.00	0.04
CH0465767769	1 % Credit Agricole 19-25 NT	3'800'000	CHF	97.15 %	3'691'700.00	0.24
CH0485445982	0 % Nationwide Building Society 19-25	595'000	CHF	96.70 %	575'365.00	0.04
CH1154887157	0.6025 % Lloyds Banking Group 22-29	2'000'000	CHF	89.70 %	1'794'000.00	0.12
CH1167887277	0.8975 % NatWest Markets 22-25 NT	2'000'000	CHF	97.95 %	1'959'000.00	0.13
CH1199322384	0.9194 % Nationwide Building Society 22-25 Tranche 1	2'840'000	CHF	97.80 %	2'777'520.00	0.18
CH1204175124	1.915 % Nationwide Building Society 22-28 NT	3'460'000	CHF	96.70 %	3'345'820.00	0.22
CH1216400056	2.155 % Korea Housing Finance 22-25	980'000	CHF	100.15 %	981'470.00	0.06
CH1216400064	2.465 % Korea Housing Finance 22-27	1'140'000	CHF	101.40 %	1'155'960.00	0.07
CH1228837865	2.33 % UBS AG, London Branch 22-25 NT	1'500'000	CHF	100.45 %	1'506'750.00	0.10
CH1231312708	2.7825 % NatWest Markets 22-27 NT	1'600'000	CHF	100.75 %	1'612'000.00	0.10
CH1236363409	1.7575 % Nationwide Building Society 23-26	795'000	CHF	99.65 %	792'217.50	0.05
CH1236363417	2.0125 % Nationwide Building Society 23-30	1'960'000	CHF	100.25 %	1'964'900.00	0.13
CH1243018806	2.745 % Lloyds Banking Group 23-27 NT	3'600'000	CHF	100.15 %	3'605'400.00	0.23
CH1243933574	1.815 % Korea Housing Finance 23-26	3'420'000	CHF	99.40 %	3'399'480.00	0.22
CH1243933582	1.8925 % Korea Housing Finance 23-28 Tranche 2	980'000	CHF	99.25 %	972'650.00	0.06
CH1264823480	2.385 % UBS AG, London Branch 23-25	2'600'000	CHF	100.45 %	2'611'700.00	0.17
CH1264823498	2.55 % UBS AG, London Branch 23-29	3'000'000	CHF	100.65 %	3'019'500.00	0.20
CH1270825545	2.8575 % NatWest Markets 23-28	1'400'000	CHF	100.65 %	1'409'100.00	0.09
CH1280994281	1.87 % Lloyds Bank 23-27	3'730'000	CHF	100.00 %	3'730'000.00	0.23

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1280994299	2.97 % Nationwide Building Society 23-27	2'000'000	CHF	100.30 %	2'006'000.00	0.13
CH1292012775	2.01 % Santander UK 23-26 Series 82	2'400'000	CHF	100.40 %	2'409'600.00	0.16
<b>Grande-Bretagne</b>					<b>45'962'982.50</b>	<b>2.97</b>
CH0398677713	0.314 % CABEI 18-24 NT	520'000	CHF	98.30 %	511'160.00	0.03
CH0550103078	0.405 % CABEI 20-25 NT	2'050'000	CHF	97.10 %	1'990'550.00	0.13
CH1135555576	0.17 % CABEI 21-31 NT	1'240'000	CHF	83.95 %	1'040'980.00	0.07
CH1148308716	0.11 % CABEI 21-28 NT	1'960'000	CHF	89.35 %	1'751'260.00	0.11
CH1191066278	1.5462 % CABEI 22-26 NT	2'410'000	CHF	98.50 %	2'373'850.00	0.16
CH1231312682	2.1375 % CABEI 22-27	1'860'000	CHF	100.00 %	1'860'000.00	0.12
<b>Honduras</b>					<b>9'527'800.00</b>	<b>0.62</b>
CH0379268748	2.10 % RZD Capital 17-23 NT	4'170'000	CHF	21.25 %	886'125.00	0.06
CH0419041543	1/4 % Intesa Sanpaolo Bank Ireland 19-24 NT	3'400'000	CHF	98.11 %	3'335'740.00	0.22
CH0419041634	1.195 % RZD Capital 19-28	300'000	CHF	25.00 %	75'000.00	0.00
CH0522690715	0.84 % RZD Capital 20-26 NT	4'575'000	CHF	20.00 %	915'000.00	0.06
<b>Irlande</b>					<b>5'211'865.00</b>	<b>0.34</b>
CH0461238856	0 % Korea Railroad 19-24 NT	5'410'000	CHF	97.70 %	5'285'570.00	0.34
CH0540633044	0.445 % The Korea Development Bank 20-25	290'000	CHF	97.45 %	282'605.00	0.02
CH1121837228	0.17 % The Korea Development Bank 21-31 NT	1'370'000	CHF	85.50 %	1'171'350.00	0.08
CH1271360633	2.1725 % Korea Water Resources 23-25	3'230'000	CHF	100.30 %	3'239'690.00	0.21
CH1279261155	2.2225 % The Korea Development Bank 23-26 NT	2'640'000	CHF	100.30 %	2'647'920.00	0.17
<b>Corée du Sud</b>					<b>12'627'135.00</b>	<b>0.82</b>
CH0360677287	1/2 % LGT Bank 17-27	460'000	CHF	94.75 %	435'850.00	0.03
CH0484360372	3/8 % LGT Bank NT 19-28	1'600'000	CHF	90.50 %	1'448'000.00	0.09
CH1212189158	2 3/4 % LGT Bank 22-32	520'000	CHF	103.20 %	536'640.00	0.03
CH1243651929	2 1/2 % LGT Bank 23-33 NT	880'000	CHF	101.20 %	890'560.00	0.06
<b>Liechtenstein</b>					<b>3'311'050.00</b>	<b>0.21</b>
CH0022333980	2 1/2 % Commerzbank Finance & Covered Bond 05-25	1'700'000	CHF	100.75 %	1'712'750.00	0.12
CH0398677689	0.732 % Aroundtown 18-25 NT	1'225'000	CHF	94.00 %	1'151'500.00	0.07
<b>Luxembourg</b>					<b>2'864'250.00</b>	<b>0.19</b>
CH0511762038	0.5225 % Africa Finance 19-23 NT	2'845'000	CHF	99.49 %	2'830'490.50	0.18
<b>Nigéria</b>					<b>2'830'490.50</b>	<b>0.18</b>
CH0190125036	1 3/8 % NWB 12-27 NT	3'420'000	CHF	98.85 %	3'380'670.00	0.23
CH0315593860	0.30 % ABN AMRO Bank 16-24	305'000	CHF	97.94 %	298'717.00	0.02
CH0363645505	1/2 % Achmea Bank 17-23 NT	1'760'000	CHF	99.88 %	1'757'888.00	0.11
CH1121837244	0.55 % Digital Intrepid Holding 21-29 NT	1'170'000	CHF	87.30 %	1'021'410.00	0.07
CH1174335724	0.235 % Nederlandse Waterschapsbank 22-27	650'000	CHF	95.10 %	618'150.00	0.04
CH1175016125	1.70 % Digital Intrepid Holding 22-27	1'430'000	CHF	95.95 %	1'372'085.00	0.09
CH1251030099	2 5/8 % ABN AMRO Bank 23-28	800'000	CHF	99.95 %	799'600.00	0.05
CH1256367181	1.7925 % BNG Bank 23-28 NT	2'370'000	CHF	100.80 %	2'388'960.00	0.15
CH1264823506	1.6875 % BNG Bank 23-30 NT	3'130'000	CHF	100.05 %	3'131'565.00	0.20

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1273475421	2.30 % ABN AMRO Bank 23-25 Tranche 1 NT	2'800'000	CHF	100.15 %	2'804'200.00	0.18
CH1276269722	2.505 % ABN AMRO Bank 23-28 Tranche 2 NT	800'000	CHF	100.85 %	806'800.00	0.05
<b>Pays-Bas</b>					<b>18'380'045.00</b>	<b>1.19</b>
CH1132966271	1/8 % SpareBank 1 Nord-Norge 21-28 NT	1'000'000	CHF	90.20 %	902'000.00	0.06
CH1174335815	0.545 % Kommunalbanken 22-28	910'000	CHF	94.95 %	864'045.00	0.06
CH1184694730	1.1675 % DNB Bank 22-27	2'120'000	CHF	96.60 %	2'047'920.00	0.13
CH1184694789	1 1/2 % SpareBank 1 SMN 22-27 NT	460'000	CHF	97.15 %	446'890.00	0.03
CH1230759537	1.275 % Kommunalbanken 22-27	1'080'000	CHF	98.35 %	1'062'180.00	0.07
CH1249416012	2.70 % SpareBank 1 Nord-Norge 23-29 NT	800'000	CHF	99.85 %	798'800.00	0.05
CH1271360583	1.81 % Kommunalbanken 23-30 nt	1'570'000	CHF	100.55 %	1'578'635.00	0.10
<b>Norvège</b>					<b>7'700'470.00</b>	<b>0.50</b>
CH0238765116	1 1/2 % Auckland Council 14-25 NT	550'000	CHF	99.35 %	546'425.00	0.04
CH0461238997	0.02 % Transpower New Zealand 19-27	1'530'000	CHF	92.10 %	1'409'130.00	0.09
CH0522158838	0.0375 % Transpower New Zealand 21-29	2'080'000	CHF	90.30 %	1'878'240.00	0.12
CH1216400080	1.66 % Auckland Council 22-27 NT	1'240'000	CHF	99.65 %	1'235'660.00	0.08
<b>Nouvelle-Zélande</b>					<b>5'069'455.00</b>	<b>0.33</b>
CH1243933590	2.4275 % Corporacion Andina de Fomento 23-30	1'860'000	CHF	99.70 %	1'854'420.00	0.12
<b>Panama</b>					<b>1'854'420.00</b>	<b>0.12</b>
CH1191066245	0.80 % Asian Development Bank 22-27 NT	520'000	CHF	97.25 %	505'700.00	0.03
<b>Philippines</b>					<b>505'700.00</b>	<b>0.03</b>
CH0301549348	1/4 % Akademiska Hus 15-25	1'080'000	CHF	96.80 %	1'045'440.00	0.07
CH0373945085	0.30 % Akademiska Hus 17-29 NT	1'445'000	CHF	91.65 %	1'324'342.50	0.09
CH0406415304	0.20 % Lansforsakringar Hypotek 18-26 NT	880'000	CHF	95.90 %	843'920.00	0.05
CH1184694714	1 1/4 % Svenska Handelsbanken 22-27 NT	1'300'000	CHF	97.05 %	1'261'650.00	0.08
CH1184694748	0.78 % Akademiska Hus 22-28 NT	650'000	CHF	95.80 %	622'700.00	0.04
CH1204259795	1.0225 % Swedisch Export Credit 22-27 Tranche 1 Reg S	2'350'000	CHF	97.55 %	2'292'425.00	0.15
CH1212189133	1.68 % Akademiska Hus 22-32 NT	2'320'000	CHF	98.40 %	2'282'880.00	0.15
CH1239494979	1.7125 % Aktiebolaget Svensk Exportkredit 23-30	2'180'000	CHF	100.00 %	2'180'000.00	0.14
CH1249416020	1.9925 % Akademiska Hus 23-33 NT	1'550'000	CHF	100.90 %	1'563'950.00	0.10
CH1271360401	2.7725 % Swedbank 23-28 NT	1'200'000	CHF	100.50 %	1'206'000.00	0.08
CH1271360419	1.8425 % Akademiska Hus 23-35	1'630'000	CHF	99.00 %	1'613'700.00	0.10
<b>Suède</b>					<b>16'237'007.50</b>	<b>1.05</b>
CH0271171685	3/8 % Apple 15-24	2'150'000	CHF	98.36 %	2'114'740.00	0.14
CH0278346769	1/4 % North American Development Bank 15-25	260'000	CHF	97.30 %	252'980.00	0.02
CH0347556885	0.30 % Metropolitan Life Global Funding 17-26 NT Series 144	550'000	CHF	95.95 %	527'725.00	0.03
CH0362748276	0.20 % North American Development Bank 17-27	750'000	CHF	93.45 %	700'875.00	0.05
CH0367206676	1 % Verizon Communications 17-27	2'595'000	CHF	95.65 %	2'482'117.50	0.16
CH0373945044	3/8 % Jackson National Life Global Funding 17-25 NT	650'000	CHF	96.25 %	625'625.00	0.04
CH0423233540	0.30 % North American Development Bank 18-26	2'050'000	CHF	95.75 %	1'962'875.00	0.13
CH0423233565	0.30 % Jackson National Life Global Funding 18-23 NT	3'750'000	CHF	99.63 %	3'736'125.00	0.22
CH0471297959	1/4 % New York Life Global Funding 19-27 NT Unitary 144A	2'350'000	CHF	92.85 %	2'181'975.00	0.14

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0482172340	1/8 % Metropolitan Life Global Funding 19-27 NT Reg S	3'470'000	CHF	92.65 %	3'214'955.00	0.21
CH0517825268	1/8 % Jackson National Life Global Funding 20-28 Unitary 144	620'000	CHF	88.00 %	545'600.00	0.04
CH0545766542	0.20 % North American Development Bank 20-28	3'475'000	CHF	92.00 %	3'197'000.00	0.21
CH0545766559	0.55 % North American Development Bank 20-33	3'020'000	CHF	86.60 %	2'615'320.00	0.17
CH0564642095	1/8 % New York Life Global Funding 20-29	1'830'000	CHF	88.45 %	1'618'635.00	0.10
CH0569237677	1/8 % Metropolitan Life Global Funding 20-28 NT	240'000	CHF	90.10 %	216'240.00	0.01
CH1137122839	1/4 % Pacific Life Global Funding II 21-28 NT	2'555'000	CHF	88.95 %	2'272'672.50	0.15
CH1179534982	1 3/8 % New York Life Global Funding 22-28 NT	1'830'000	CHF	96.55 %	1'766'865.00	0.11
CH1199659934	2.15 % Metropolitan Life Global Funding 22-26 Reg S	1'010'000	CHF	99.95 %	1'009'495.00	0.07
CH1255924461	2.65 % Massmutual Global Funding II 23-28 Series 2023-4	1'300'000	CHF	101.75 %	1'322'750.00	0.09
CH1271360625	2 7/8 % Equinix 23-28	1'960'000	CHF	101.50 %	1'989'400.00	0.13
<b>Etats-Unis</b>					<b>34'353'970.00</b>	<b>2.22</b>

CH0270382093	1/2 % Corporacion Andina De Fomento 15-26	770'000	CHF	95.85 %	738'045.00	0.05
CH0360172727	0.30 % Andean Development Corporation 17-25 NT	590'000	CHF	97.15 %	573'185.00	0.04
CH0553331882	0.70 % Corporacion Andina De Fomento 20-25 NT	5'055'000	CHF	97.15 %	4'910'932.50	0.32
CH1151526238	0.45 % Andean Development Corp. 22-27 NT	1'370'000	CHF	93.70 %	1'283'690.00	0.08
CH1210198128	2.08 % Corporacion Andina De Fomento 22-28	2'670'000	CHF	98.80 %	2'637'960.00	0.17
<b>Vénézuéla</b>					<b>10'143'812.50</b>	<b>0.66</b>

## Valeurs mobilières non cotées en bourse

<b>Obligations</b>					<b>4'002'240.00</b>	<b>0.26</b>
CH1294486365	3.61 % DZ BANK 23-28	1'600'000	CHF	100.17 %	1'602'720.00	0.10
<b>Allemagne</b>					<b>1'602'720.00</b>	<b>0.10</b>
CH1296276152	2.47 % Achmea Bank 23-26 NT	2'400'000	CHF	99.98 %	2'399'520.00	0.16
<b>Pays-Bas</b>					<b>2'399'520.00</b>	<b>0.16</b>

Inventaire résumé	Valeur vénale	en %
Avoirs en banque à vue	18'622'432.15	1.20
Obligations, obligations convertibles, emprunts à option et autres titres de créance et droits-valeurs	1'519'544'329.38	98.23
Autres actifs	8'875'689.55	0.57
<b>Fortune totale du fonds à la fin de la période comptable</b>	<b>1'547'042'451.08</b>	<b>100.00</b>
Autres engagements	-230'293.72	
<b>Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable</b>	<b>1'546'812'157.36</b>	



## Risques sur instruments financiers dérivés selon l'approche Commitment I

<b>Engagement du fonds</b>	<b>% de la fortune nette</b>	<b>Montant</b>
Total des positions augmentant l'engagement	0%	0
Total des positions réduisant l'engagement	0%	0
<b>Informations supplémentaires et opérations hors-bilan</b>		
Valeurs mobilières prêtées à la date du bilan		0
Valeurs mobilières mises en pension à la date du bilan		0
Montant du compte prévu pour être réinvesti		0
<b>Type et montant des sûretés acceptées</b>		
Aucune sûreté acceptée		0
<b>Contreparties pour les opérations over-the-counter (OTC)</b>		
Aucune		

## Liste des transactions pendant la période comptable

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
<b>Positions ouvertes à la fin de la période comptable</b>			
<b>Obligations</b>			
CH0008680370	4 % Confederation Suisse 98-28	1'460'000	8'800'000
CH0009755197	4 % Confederation Suisse 99-49	0	960'000
CH0015803239	3 1/2 % Confederation Suisse 03-33	500'000	780'000
CH0020498645	2 3/4 % Stadt Zuerich 05-25	0	520'000
CH0020632144	2 7/8 % OEKB 05-30	3'150'000	1'270'000
CH0020810468	3 % Luzerner KB 05-25	0	580'000
CH0022333980	2 1/2 % Commerzbank Finance & Covered Bond 05-25	0	900'000
CH0024141100	2 1/2 % CFF 06-31 NT	160'000	130'000
CH0024524966	2 1/2 % Confederation Suisse 06-36	1'600'000	5'010'000
CH0025185676	3 % Eurofima 06-26	250'000	2'090'000
CH0026985520	2 7/8 % Kommunekredit 06-31 NT	200'000	870'000
CH0027752200	2 5/8 % OEKB 06-24	0	200'000
CH0031835561	3 1/4 % Confederation Suisse 07-27	700'000	2'680'000
CH0115967397	2 1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 10-32 Series 519	200'000	1'150'000
CH0117076379	1 7/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 10-31 Series 524	650'000	3'170'000
CH0118095667	1 7/8 % Basler KB 10-26	150'000	1'740'000
CH0118886735	2 % SNCF Reseau 10-26 NT	0	700'000
CH0119015086	2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 10-25 Series 405	100'000	1'340'000
CH0120168486	2 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 10-28 Series 533	300'000	800'000
CH0124338937	2 5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 11-31 Series 548	9'300'000	3'230'000
CH0126977641	2 1/4 % Kanton Bern 11-26	0	470'000
CH0127181029	2 1/4 % Confederation Suisse 11-31	500'000	2'790'000
CH0127181169	1 1/2 % Confederation Suisse 12-42	1'200'000	5'400'000
CH0127181193	1 1/4 % Confederation Suisse 12-37	700'000	1'810'000
CH0132163434	2 7/8 % KW Linth-Limmern 11-31	80'000	310'000
CH0138760811	1 5/8 % Stadt Bern 11-24	0	330'000
CH0139458720	1 1/2 % Canton de Geneve 11-24	0	1'740'000
CH0141833407	1 3/4 % Basellandschaftliche KB 11-24	0	1'740'000
CH0142132031	1 1/2 % Canton de Geneve 12-28	0	350'000
CH0143808340	1 1/4 % Kanton Bern 12-27	0	700'000
CH0147144361	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 12-28 Series 562	500'000	2'430'000
CH0149549575	1 1/2 % Basler KB 12-27	100'000	730'000
CH0180428531	2 7/8 % KW Linth-Limmern 12-42	0	150'000
CH0181215028	1 3/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 12-27 Series 420	400'000	1'240'000
CH0184043542	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 12-27 Series 566	0	1'040'000
CH0185907083	1 3/8 % Municipality Finance 12-27 NT	100'000	100'000
CH0190125036	1 3/8 % NWB 12-27 NT	50'000	1'830'000
CH0190369378	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 12-33 Series 569	200'000	420'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0192241278	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 12-27 Series 572	500'000	170'000
CH0193395537	1 1/4 % Canton de Neuchatel 12-27	0	730'000
CH0194273204	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 12-29 Series 574	400'000	2'070'000
CH0194958960	3 % KW Linth-Limmern 12-52	0	270'000
CH0200044789	2 3/8 % Nant de Drance 13-28	55'000	110'000
CH0200044805	1 7/8 % KW Oberhasli 13-25	50'000	160'000
CH0204811100	1 5/8 % Swissgrid 13-25	250'000	250'000
CH0206728823	1 1/2 % Stadt Bern 13-28	0	1'040'000
CH0206894740	1 3/8 % Graubundner KB 13-25	250'000	1'330'000
CH0206992270	1 1/2 % Thurgauer KB 13-27	1'000'000	1'040'000
CH0208271541	3 % KW Linth-Limmern 13-48	200'000	450'000
CH0211588949	1 5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 13-30 Series 581	500'000	170'000
CH0212937244	1 3/4 % CRH 13-25	3'000'000	1'040'000
CH0217756656	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 13-25 Series 584	250'000	2'520'000
CH0217825311	1 3/4 % Kanton St-Gallen 13-28	0	1'040'000
CH0221999813	1 5/8 % Stadt Zuerich 13-24	150'000	2'830'000
CH0222261494	1 3/4 % Thurgauer KB 13-24	100'000	1'080'000
CH0224396983	1 1/4 % Confederation Suisse 14-26	500'000	4'100'000
CH0224397007	2 % Confederation Suisse 14-64	300'000	100'000
CH0224397171	1/2 % Confederation Suisse 15-30	1'355'000	9'940'000
CH0224397338	1/2 % Confederation Suisse 16-58	300'000	2'680'000
CH0224397346	0 % Confederation Suisse 16-29	3'000'000	15'190'000
CH0224485927	2 % Canton de Vaud 13-33	0	700'000
CH0224923513	1 3/4 % Schaffhauser KB 13-25	0	520'000
CH0228531437	2 3/8 % KW Linth-Limmern 13-26	200'000	960'000
CH0235475354	1 5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 14-26 Series 445	200'000	260'000
CH0235834154	1 1/2 % Deutsche Bahn Finance 14-24	450'000	1'130'000
CH0238765116	1 1/2 % Auckland Council 14-25 NT	240'000	290'000
CH0239840124	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 14-24 Series 591	400'000	830'000
CH0241926317	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 14-25 Series 593	0	1'440'000
CH0244175201	1 1/4 % Banque Cantonale de Fribourg 14-24	100'000	1'770'000
CH0251885791	3/4 % Municipality Finance 14-24	0	770'000
CH0252379802	1 7/8 % Mobimo Holding 14-24	200'000	640'000
CH0252703050	1 1/4 % KW Linth-Limmern 14-24	0	750'000
CH0252903767	1 3/8 % Kanton Basel-Stadt 14-34	0	570'000
CH0254212233	1 % Kanton Zuerich 14-27	150'000	370'000
CH0255678333	1 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 14-26 Series 598	100'000	1'520'000
CH0255678341	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 14-32 Series 599	0	1'050'000
CH0257042173	2 % Swiss Prime Site Finance 14-24	0	350'000
CH0258404455	3/4 % Province of Quebec 14-24 NT	0	770'000
CH0261399064	1 1/8 % Baloise-Holding 14-24	350'000	240'000
CH0262883199	1 3/8 % Grande Dixence 15-25	150'000	580'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0263432988	1 % Centr. LdG Bques Cant. CH 14-28 Series 459	600'000	1'600'000
CH0264227015	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 14-25 Series 603	600'000	1'950'000
CH0265801198	0.55 % Banque Cantonale de Fribourg 15-25	300'000	540'000
CH0267222310	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-30 Series 604	700'000	1'630'000
CH0267855986	1/8 % Kanton Baselland 15-26	0	630'000
CH0268786982	5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-30 Series 460	100'000	1'670'000
CH0268988182	1 % Swisscom 15-35 Tranche 2	100'000	720'000
CH0269697931	3/8 % Schaffhauser KB 15-27	3'000'000	1'040'000
CH0269796212	1/2 % Thurgauer KB 15-29	0	350'000
CH0270190983	1/4 % Novartis 15-25	0	280'000
CH0270190991	5/8 % Novartis 15-29	200'000	950'000
CH0270191007	1.05 % Novartis 15-35	90'000	310'000
CH0270382093	1/2 % Corporacion Andina De Fomento 15-26	0	410'000
CH0271171685	3/8 % Apple 15-24	250'000	1'150'000
CH0271288547	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-28 Series 605	200'000	1'430'000
CH0272154177	1 % Kanton Baselland 15-40	0	70'000
CH0273347838	1 3/8 % Allreal Holding 15-25	100'000	720'000
CH0273485398	5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-29 Series 462	205'000	1'110'000
CH0274253514	0.60 % Banque Cantonale de Fribourg 15-27	350'000	2'210'000
CH0274314787	3/4 % Basellandschaftliche KB 15-28	2'000'000	700'000
CH0275352125	3/8 % Thurgauer KB 15-25	200'000	590'000
CH0276581094	0.55 % Spitalverband Limmattal 15-25	100'000	380'000
CH0278346769	1/4 % North American Development Bank 15-25	0	140'000
CH0278667115	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-30 Series 464	250'000	1'830'000
CH0279720343	1/4 % Basellandschaftliche KB 15-25	200'000	590'000
CH0280569135	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-34 Series 610	500'000	870'000
CH0282019006	1 1/4 % Services Industriels de Geneve 15-25	0	140'000
CH0282528899	7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-37 Series 611	0	1'170'000
CH0284087589	1/2 % St Galler KB 15-25	200'000	1'460'000
CH0284415681	0.55 % Nordea Bank 15-25 NT	150'000	920'000
CH0284687404	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-25 Series 613	0	300'000
CH0285597370	5/8 % Kommunekredit 15-27 NT	0	190'000
CH0285849367	5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-27 Series 466	300'000	4'070'000
CH0286138877	3/4 % Berner KB 15-25	200'000	1'000'000
CH0288286385	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-25 Series 467	500'000	2'380'000
CH0290876512	5/8 % Lugano 15-25	210'000	770'000
CH0291625231	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-26 Series 616	800'000	3'120'000
CH0292984470	1 1/4 % Nant de Drance 15-23	220'000	1'000'000
CH0293026222	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-31 Series 617	400'000	1'180'000
CH0295186388	3/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-25 Series 469	0	1'840'000
CH0297132364	1 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-36 Series 619	620'000	3'690'000
CH0297343565	1/2 % Kanton Solothurn 15-30 Tranche 2	100'000	350'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0299297280	3/4 % ZKB 15-30 Series 135	400'000	1'010'000
CH0300874283	5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-30 Series 471	0	2'160'000
CH0301549348	1/4 % Akademiska Hus 15-25	100'000	570'000
CH0302424392	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-29 Series 621	400'000	3'030'000
CH0304755157	3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-34 Series 623	3'500'000	1'500'000
CH0305954569	1/4 % Kanton Aargau 15-29 Tr. 2	200'000	770'000
CH0306173730	1/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-26 Series 473	0	1'580'000
CH0306173748	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-30 Series 474	0	1'570'000
CH0306626224	2 % Nant de Drance 16-26	165'000	530'000
CH0307256435	1/2 % PSP Swiss Property 16-24	150'000	2'000'000
CH0307256450	0.60 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-35 Series 476	920'000	3'550'000
CH0310175564	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-26 Series 625	0	2'520'000
CH0310451858	1 1/4 % UBS Group Funding (Switzerland) 16-26 Tranche 2	0	400'000
CH0310646523	1/2 % Banque Cantonale de Fribourg 16-28	450'000	1'370'000
CH0312512640	1/4 % Graubundner KB 16-28	0	350'000
CH0315593860	0.30 % ABN AMRO Bank 16-24	0	170'000
CH0319415920	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-28 Series 627	650'000	230'000
CH0319415938	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-32 Series 628	500'000	1'910'000
CH0319416126	0.04 % Stadt Bern 16-27	200'000	940'000
CH0319932767	0.40 % BCV 16-31	0	1'630'000
CH0320712596	0.30 % Raiffeisen Suisse 16-25 Tranche 1	0	260'000
CH0326213912	1/4 % Kinderspital Zuerich - Eleonorenstiftung 16-28	330'000	910'000
CH0326213920	0.60 % Canton de Geneve 16-46	100'000	730'000
CH0328298069	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-39 Series 632	200'000	590'000
CH0330143188	0.02 % ZKB 16-27 Series 139	400'000	1'630'000
CH0330938835	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-38 Series 633	300'000	1'070'000
CH0331455334	0 % Kanton Basel-Stadt 16-26	100'000	730'000
CH0336352742	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-31 Series 635	0	1'040'000
CH0336352767	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-46 Series 637	220'000	420'000
CH0336587719	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-27 Series 483	1'000'000	6'250'000
CH0336587735	0.18 % Cembra Money Bank 16-23	0	330'000
CH0337645581	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-26 Series 485	0	1'180'000
CH0338330415	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-32 Series 639	200'000	1'250'000
CH0338330472	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-36 Series 641	500'000	2'980'000
CH0340953428	1/2 % BCV 16-28	150'000	860'000
CH0342587638	0.05 % ZKB 16-26 Series 140	0	1'040'000
CH0344583809	1/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-24 Series 486	0	2'430'000
CH0344583817	3/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-28 Series 487	0	700'000
CH0344958472	1/2 % Confederation Suisse 17-55	300'000	1'770'000
CH0344958498	1/2 % Confederation Suisse 17-45	1'785'000	8'470'000
CH0344958688	1/2 % Confederation Suisse 18-32	1'650'000	7'390'000
CH0347556885	0.30 % Metropolitan Life Global Funding 17-26 NT Series 144	100'000	300'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0347556927	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-37 Series 645	300'000	2'720'000
CH0352419615	5/8 % St Galler KB 17-32	150'000	430'000
CH0352595885	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-27 Series 489	500'000	2'290'000
CH0352595893	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 17-32 Series 490	500'000	3'120'000
CH0353105197	3/8 % Thurgauer KB 17-28	200'000	770'000
CH0353428037	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-29 Series 646	0	2'540'000
CH0353574319	0.30 % Basler KB 17-27	250'000	260'000
CH0354836113	3/4 % Mobimo Holding 17-26	0	240'000
CH0357483160	2 % KW Linth-Limmern 17-23	300'000	1'460'000
CH0357676110	7/8 % Allreal Holding 17-27	50'000	260'000
CH0357676177	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 17-29 Series 493	800'000	1'840'000
CH0358654975	0.10 % Roche Kapitalmarkt 17-24 Tranche 2	100'000	870'000
CH0359915409	0.45 % Roche Kapitalmarkt 17-29 Tranche 3	0	430'000
CH0360172727	0.30 % Andean Development Corporation 17-25 NT	0	310'000
CH0360677287	1/2 % LGT Bank 17-27	0	240'000
CH0360677295	0.825 % Swiss Prime Site Finance 17-26	150'000	900'000
CH0361532820	1/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 17-27 Series 494	500'000	2'440'000
CH0361532895	0.15 % Partners Group Holding 17-24	250'000	1'790'000
CH0361532911	1/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 17-26 Series 495	0	2'090'000
CH0361532952	1 1/8 % Grande Dixence 17-24	400'000	1'580'000
CH0361533125	5/8 % Municipality Finance 17-38	100'000	210'000
CH0362748276	0.20 % North American Development Bank 17-27	0	400'000
CH0363645505	1/2 % Achmea Bank 17-23 NT	200'000	940'000
CH0367206676	1 % Verizon Communications 17-27	150'000	1'390'000
CH0367206718	3/8 % Cembra Money Bank 17-25	0	1'460'000
CH0367206759	1/4 % Province of Ontario 17-29	0	140'000
CH0368825474	0.40 % Banque Federative du Credit Mutuel 17-25 NT	0	870'000
CH0370634666	5/8 % Credit Agricole 17-24 NT	0	350'000
CH0370943547	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-26 Series 651	300'000	2'380'000
CH0373476040	1/2 % Banque Cler 17-25	0	210'000
CH0373476339	0.30 % ZKB 18-28 Series 142	0	350'000
CH0373476412	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 18-28 Series 499	750'000	3'100'000
CH0373476420	0.65 % Centr. LdG Bques Cant. CH 18-33 Series 500	500'000	2'230'000
CH0373476776	1/8 % Graubuendner KB 18-24	200'000	970'000
CH0373476784	1/2 % Schaffhauser KB 18-28	100'000	380'000
CH0373476800	3/4 % Coop-Gruppe Genossenschaft 18-25	0	760'000
CH0373476966	3/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 18-33 Series 502	650'000	230'000
CH0373945044	3/8 % Jackson National Life Global Funding 17-25 NT	0	350'000
CH0373945085	0.30 % Akademiska Hus 17-29 NT	215'000	770'000
CH0379268748	2.10 % RZD Capital 17-23 NT	400'000	0
CH0379354225	1/4 % Aargauische KB 17-26	250'000	430'000
CH0384125073	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-30 Series 655	800'000	280'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0386949348	0.30 % Caisse des Depots et Consignations 17-27 NT	0	600'000
CH0391648018	1.55 % Nant de Drance 18-25	100'000	310'000
CH0397450724	1/4 % Basellandschaftliche KB 18-27	600'000	2'050'000
CH0398633229	1/2 % Zurich Compagnie d'Assurances 18-24 NT	0	1'320'000
CH0398633575	5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 18-29 Series 507	200'000	560'000
CH0398633799	0.15 % ZKB 19-27 Series 144	300'000	1'340'000
CH0398633807	0.70 % PSP Swiss Property 19-27 Reg S	0	210'000
CH0398633922	3/8 % Graubuendner KB 19-32	300'000	1'150'000
CH0398677689	0.732 % Aroundtown 18-25 NT	150'000	650'000
CH0398677713	0.314 % CABEI 18-24 NT	0	280'000
CH0399611307	0.35 % Luzerner KB 18-27	905'000	310'000
CH0405985836	0.70 % Thurgauer KB 18-30	250'000	1'480'000
CH0405986057	1/4 % Aargauische KB 18-25	200'000	1'030'000
CH0406415304	0.20 % Lansforsakringar Hypotek 18-26 NT	0	470'000
CH0411478099	0.40 % BEKB 18-27	1'500'000	630'000
CH0413618353	0.70 % Kantonsspital Baden 18-28	100'000	750'000
CH0413618361	1.10 % Kantonsspital Baden 18-33	100'000	140'000
CH0414510062	1/4 % Caisse des Depots et Consignations 18-25	0	400'000
CH0419040800	0.41 % Luzerner KB 19-29	100'000	990'000
CH0419040842	0.55 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-31 Series 508	725'000	2'900'000
CH0419040891	1/2 % Kanton Basel-Stadt 19-34	0	700'000
CH0419040925	1.05 % Ville de Lausanne 19-44	50'000	710'000
CH0419040941	0.30 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-29 Series 509	800'000	4'450'000
CH0419040958	0.70 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-39 Series 510	485'000	520'000
CH0419040982	1/2 % Swisscom 19-29	100'000	1'780'000
CH0419040990	1 1/4 % Swiss Prime Site Finance 19-27	100'000	280'000
CH0419041006	0.15 % Basler KB 19-27	300'000	2'020'000
CH0419041071	5/8 % Ville de Bienne 19-27	0	350'000
CH0419041188	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-34 Series 513	300'000	2'120'000
CH0419041238	1/8 % ZKB 19-29 Series 145	0	700'000
CH0419041337	0 % Valiant Bank 19-29	500'000	1'240'000
CH0419041352	0.285 % Cembra Money Bank 19-27	0	170'000
CH0419041378	5/8 % Aarekraftwerk Klingnau 19-29	0	230'000
CH0419041428	0 % Kantonsspital Winterthur 19-31	100'000	170'000
CH0419041436	0 % Aargauische KB 19-29	250'000	700'000
CH0419041469	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-37 Series 514	250'000	1'130'000
CH0419041485	0.10 % Berner KB 19-39	160'000	710'000
CH0419041543	1/4 % Intesa Sanpaolo Bank Ireland 19-24 NT	400'000	2'000'000
CH0419041584	0.10 % St.Galler KB 19-41	230'000	1'650'000
CH0419041667	0.07 % First Abu Dhabi Bank 19-27 NT	0	170'000
CH0419041675	0 % Banque Valiant 19-25	150'000	2'020'000
CH0419042509	3/4 % Nestle 18-28	150'000	920'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0423233516	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-25 Series 659	400'000	1'760'000
CH0423233524	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-29 Series 660	0	1'270'000
CH0423233540	0.30 % North American Development Bank 18-26	1'290'000	1'090'000
CH0423233565	0.30 % Jackson National Life Global Funding 18-23 NT	0	2'000'000
CH0428194242	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-28 Series 661	800'000	1'770'000
CH0433761316	3/4 % Roche Kapitalmarkt 18-30	0	210'000
CH0434678394	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-28 Series 663	200'000	1'110'000
CH0435590382	1/2 % Credit Agricole 18-28	1'000'000	1'060'000
CH0437180935	3/4 % Swisscom 18-28	300'000	950'000
CH0438965581	1 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-47 Series 665	400'000	1'280'000
CH0440081393	0 % Confederation Suisse 19-34	870'000	7'850'000
CH0440081401	0 % Confederation Suisse 19-39	900'000	5'960'000
CH0440081567	1 1/2 % Confederation Suisse 22-38	1'000'000	4'870'000
CH0441186480	1/4 % Hypo Vorarlberg Bank 18-25	3'215'000	1'190'000
CH0441186506	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-27 Series 666	500'000	1'910'000
CH0459297435	7/8 % UBS Group 19-25	400'000	1'200'000
CH0459810534	1/8 % Aargauische KB 19-26	250'000	2'170'000
CH0460054403	0.45 % Banca dello Stato del Cantone Ticino 19-29	100'000	440'000
CH0460054429	7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-43 Series 668	250'000	1'480'000
CH0460054452	1/4 % Province of Manitoba 19-29 NT	150'000	920'000
CH0461238856	0 % Korea Railroad 19-24 NT	600'000	2'890'000
CH0461238963	0.10 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-31 Series 515	400'000	4'400'000
CH0461238997	0.02 % Transpower New Zealand 19-27	590'000	500'000
CH0461239029	1/8 % Banque Valiant 19-34	0	1'050'000
CH0461239045	0.05 % ZKB 20-31 Series 146	370'000	1'870'000
CH0461239086	0.05 % Basellandschaftliche KB 20-31	320'000	1'170'000
CH0463112042	0.578 % FONPLATA 19-24	200'000	540'000
CH0463112075	7/8 % Societe Generale 19-24 NT	400'000	1'200'000
CH0465767769	1 % Credit Agricole 19-25 NT	400'000	2'200'000
CH0471297926	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-30 Series 671	5'000'000	2'780'000
CH0471297959	1/4 % New York Life Global Funding 19-27 NT Unitary 144A	400'000	1'250'000
CH0471298007	0.40 % Banco de Credito e Inversiones 19-24 NT	0	140'000
CH0474977698	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-29 Series 672	0	1'900'000
CH0474977714	0.205 % First Abu Dhabi Bank 19-25	450'000	260'000
CH0474977730	0.80 % Grande Dixence 19-26	100'000	940'000
CH0479514264	0.20 % Banque Federative du Credit Mutuel 19-26 NT	0	280'000
CH0479514272	0.10 % Deutsche Bahn Finance 19-29 NT Guaranteed	0	140'000
CH0481013768	0.20 % Muenchener Hypothekenbank 19-31	200'000	240'000
CH0482172340	1/8 % Metropolitan Life Global Funding 19-27 NT Reg S	100'000	1'850'000
CH0482172399	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-41 Series 674	340'000	1'270'000
CH0483180938	0.05 % Banca dello Stato del Cantone Ticino 19-29	0	1'480'000
CH0484360372	3/8 % LGT Bank NT 19-28	0	800'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés



ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0484360380	1/4 % Kanton Zuerich 19-39	225'000	1'950'000
CH0485252800	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-27 Series 675	0	2'090'000
CH0485252818	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-34 Series 676	600'000	3'320'000
CH0485252826	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-44 Series 677	200'000	980'000
CH0485252875	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-49 Series 678	100'000	1'610'000
CH0485260902	0.10 % Banque Cantonale de Fribourg 19-44	120'000	1'120'000
CH0485445982	0 % Nationwide Building Society 19-25	0	320'000
CH0494734335	0 % Swisscom 19-44	0	170'000
CH0494734392	0 % Canton de Geneve 19-59	50'000	420'000
CH0496692978	0 % Baloise-Holding 19-26	0	210'000
CH0505011913	0 % Canton de Geneve 19-28	90'000	470'000
CH0505011947	0.20 % Banco Santander 19-27	0	250'000
CH0506071114	0 % Banque Cantonale de Fribourg 20-30	350'000	470'000
CH0506071163	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-31 Series 517	1'000'000	4'020'000
CH0506071171	0.02 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-40 Series 518	0	1'390'000
CH0506071205	0.15 % BNP Paribas 20-28 NT	200'000	1'400'000
CH0506071221	0 % ZKB 20-30 Series 147	0	340'000
CH0506071270	0.14 % Banque Cantonale de Fribourg 20-30	0	1'370'000
CH0506071288	0.01 % Aargauische KB 20-28	0	890'000
CH0506071296	0 % Kanton Luzern 20-30	0	1'040'000
CH0506071338	1/8 % Luzerner KB 20-32	1'750'000	610'000
CH0508785752	1/4 % Stadt Zuerich 19-39	350'000	1'880'000
CH0511762038	0.5225 % Africa Finance 19-23 NT	350'000	1'520'000
CH0511762061	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-27 Series 682	350'000	2'140'000
CH0515152467	0.13 % Swisscom 20-31	0	170'000
CH0515152483	0.405 % Raiffeisen Suisse 21-29 Series 3	200'000	600'000
CH0517825268	1/8 % Jackson National Life Global Funding 20-28 Unitary 144	450'000	330'000
CH0517825334	0.10 % Muenchener Hypothekenbank 20-25	200'000	2'200'000
CH0520663664	1/2 % Banco Mercantile Del Norte 20-24	200'000	210'000
CH0520663672	0.20 % Flughafen Zuerich 20-35	0	450'000
CH0521617339	1/4 % Societe Generale 20-27 NT	0	1'000'000
CH0522158838	0.0375 % Transpower New Zealand 21-29	1'150'000	570'000
CH0522158887	0.20 % Deutsche Bahn Finance 21-33 NT	0	630'000
CH0522158895	0 % Kanton Luzern 21-31	200'000	590'000
CH0522158945	0.10 % Aargauische KB 21-30	0	520'000
CH0522158960	0.3126 % Banque Cantonale de Fribourg 22-32	150'000	920'000
CH0522158978	0.35 % St.Galler KB 22-31	0	700'000
CH0522159000	1 5/8 % Kanton Luzern 22-42	200'000	420'000
CH0522159034	1.70 % Basellandschaftliche KB 22-42	140'000	700'000
CH0522159042	1.60 % Basellandschaftliche KB 22-32	300'000	1'150'000
CH0522159091	1.40 % St Galler KB 22-30	450'000	1'410'000
CH0522690707	1/8 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 20-26 NT	200'000	800'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0522690715	0.84 % RZD Capital 20-26 NT	200'000	0
CH0525158371	0.10 % Zurich Compagnie d'Assurances 20-32 NT	0	1'480'000
CH0525158397	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-28 Series 683	200'000	1'570'000
CH0525158413	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-45 Series 684	100'000	940'000
CH0525158462	1/8 % Hypo Vorarlberg Bank 20-30 NT	0	1'060'000
CH0528881169	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-30 Series 685	500'000	5'010'000
CH0528881201	1/4 % Canton de Geneve 20-28	0	170'000
CH0536892588	0.95 % SGS 20-26	0	900'000
CH0536892612	0.70 % Flughafen Zuerich 20-24	300'000	1'240'000
CH0536892620	1 % Firmenich International 20-23	450'000	2'510'000
CH0536892737	0 % Kanton Zuerich 20-28	0	350'000
CH0536892745	0.10 % Kanton Zuerich 20-45	100'000	1'250'000
CH0536892901	0.20 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-35 Series 523	600'000	4'730'000
CH0536893339	0.15 % Swissgrid 20-34	100'000	1'300'000
CH0536893412	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-30 Series 526	850'000	4'710'000
CH0537261924	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-27 Series 686	0	1'040'000
CH0537261932	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-40 Series 687	100'000	350'000
CH0539032950	7/8 % Adecco Group 20-25 NT	0	350'000
CH0540633044	0.445 % The Korea Development Bank 20-25	150'000	160'000
CH0543827205	1 1/4 % Nant de Drance 20-27	325'000	1'430'000
CH0545754688	1/8 % Basler KB 20-32	100'000	900'000
CH0545766542	0.20 % North American Development Bank 20-28	400'000	1'860'000
CH0545766559	0.55 % North American Development Bank 20-33	100'000	1'610'000
CH0547243235	0.05 % Canton de Geneve 20-29	200'000	1'290'000
CH0550103078	0.405 % CABEI 20-25 NT	250'000	1'100'000
CH0550413345	0.227 % SNCF 20-30 NT	0	730'000
CH0550413386	0.60 % Ville de Lausanne 20-50	50'000	1'080'000
CH0553331809	1.05 % Ferring Holding 20-25	200'000	990'000
CH0553331817	1/4 % Baloise-Holding 20-26	200'000	420'000
CH0553331858	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-30 Series 690	700'000	3'030'000
CH0553331866	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-41 Series 691	0	1'970'000
CH0553331882	0.70 % Corporacion Andina De Fomento 20-25 NT	500'000	2'690'000
CH0557778310	1/4 % Confederation Suisse 21-35	700'000	6'690'000
CH0561923837	1/4 % Muenchener Hypothekenbank 20-28	250'000	1'300'000
CH0561923845	0.80 % Sulzer 20-25	150'000	725'000
CH0561923878	0 % Stadt Zuerich 20-60	100'000	860'000
CH0564642046	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-40 Series 692	300'000	1'770'000
CH0564642053	0.07 % Credit Agricole next bank (Suisse) 20-29	0	770'000
CH0564642079	0.01 % Lindt & Spruengli 20-28	0	900'000
CH0564642095	1/8 % New York Life Global Funding 20-29	0	970'000
CH0565650832	1/4 % Basellandschaftliche KB 20-32	0	980'000
CH0568056219	0.14 % Stadt St Gallen 20-44	0	170'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0569237669	0.20 % Canton de Geneve 20-35	200'000	1'050'000
CH0569237677	1/8 % Metropolitan Life Global Funding 20-28 NT	370'000	130'000
CH0570576113	7/8 % Nant de Drance 20-29	215'000	1'330'000
CH0570576121	0.05 % ZKB 20-32 Series 148	300'000	660'000
CH0570576154	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-30 Series 528	400'000	140'000
CH0570576279	1/8 % Swissgrid 20-36	80'000	130'000
CH0572899257	1/2 % Raiffeisen Suisse 20-28	300'000	1'600'000
CH0575017071	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-29 Series 695	850'000	3'430'000
CH0575017089	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-32 Series 696	5'700'000	590'000
CH0581947816	3/8 % Swiss Prime Site Finance 21-28	85'000	380'000
CH0589030946	0 % ZKB 21-33 Series 149	150'000	1'720'000
CH0589031019	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-29 Series 529	600'000	3'170'000
CH0589031035	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-36 Series 531	0	1'220'000
CH0591084253	0.57 % Raiffeisen Suisse 21-31 Series 2	200'000	1'100'000
CH0591979619	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-41 Series 697	375'000	130'000
CH0593893917	1/8 % Hypo Vorarlberg Bank 21-28	200'000	1'110'000
CH0593893925	0.068 % First Abu Dhabi Bank 21-27 NT	150'000	2'000'000
CH0593893933	0.556 % FONPLATA 21-26	100'000	450'000
CH0598928718	3/8 % UBS Group 21-29 NT	0	800'000
CH1100259758	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-31 Series 700	300'000	2'680'000
CH1101096464	0.10 % ZKB 21-31 Series 150	300'000	800'000
CH1101096522	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-28 Series 534	0	2'260'000
CH1101096621	0 % Kanton Zuerich 21-33	350'000	640'000
CH1105672690	0.30 % Grande Dixence 21-28	0	140'000
CH1111392853	0 % Kanton Bern 21-33	0	700'000
CH1112011510	0.05 % Province of Ontario 21-33	0	350'000
CH1112011577	0.31 % Banco Santander 21-28 Tranche 1	0	170'000
CH1112011593	0.477 % CAIXABANK 21-27 Tranche 1 NT	200'000	1'000'000
CH1112011601	0.33 % Banco Santander Chile 21-27 NT	250'000	1'380'000
CH1112455766	1/4 % Swisscom 21-33	0	590'000
CH1117896477	0.03 % Province of Quebec 21-31 NT	100'000	630'000
CH1118223408	0.15 % Stiftung Kantonsspital Graubuenden 21-30	100'000	450'000
CH1118223424	0.10 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-32 Series 537	600'000	1'340'000
CH1118223481	0.05 % Kantonsspital St. Gallen 21-31	100'000	700'000
CH1118223499	0.30 % Kantonsspital St. Gallen 21-36	100'000	610'000
CH1121837228	0.17 % The Korea Development Bank 21-31 NT	0	730'000
CH1121837244	0.55 % Digital Intrepid Holding 21-29 NT	100'000	630'000
CH1122290187	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-27 Series 704	600'000	1'430'000
CH1122290237	0.05 % Muenchener Hypothekenbank 21-36	300'000	1'600'000
CH1129053794	1/8 % BCV 21-33	1'100'000	380'000
CH1129053828	0.20 % Swissgrid 21-40	0	140'000
CH1130818839	1/8 % Baloise-Holding 21-30	0	280'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH1131931243	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-31 Series 538	500'000	3'250'000
CH1131931276	0 % Kantonsspital Winterthur 21-25	200'000	590'000
CH1131931292	0 % Swissgrid 21-26	0	470'000
CH1131931318	0.20 % WWZ 21-33	0	100'000
CH1131931409	0.30 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-36 Series 540	440'000	1'890'000
CH1132966271	1/8 % SpareBank 1 Nord-Norge 21-28 NT	0	600'000
CH1132966339	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-36 Series 707	3'250'000	2'520'000
CH1132966354	1/8 % Inselspital-Stiftung 21-29	275'000	1'530'000
CH1135555576	0.17 % CABEI 21-31 NT	100'000	660'000
CH1137122755	0.05 % Tecan Group 21-25	200'000	1'190'000
CH1137122797	1/4 % Deutsche Bahn Finance 21-31	100'000	700'000
CH1137122839	1/4 % Pacific Life Global Funding II 21-28 NT	200'000	1'360'000
CH1139995810	0.01 % Muenchener Hypothekenbank 21-26	2'000'000	700'000
CH1141700430	1/4 % Stadt Zuerich 21-51	200'000	420'000
CH1141700463	0.20 % Kanton Bern 21-36	200'000	1'110'000
CH1142512347	0.5275 % BNP Paribas 22-28 NT	200'000	800'000
CH1142512362	2.8925 % BNP Paribas 22-29 NT	200'000	600'000
CH1142754287	0.795 % FONPLATA 21-28	0	700'000
CH1145096165	0.435 % UBS Group 21-28	400'000	1'000'000
CH1148266161	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-28 Series 709	350'000	1'790'000
CH1148308716	0.11 % CABEI 21-28 NT	150'000	1'040'000
CH1148728046	0.10 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-31 Series 541	400'000	3'550'000
CH1148728111	0.20 % ZKB 22-30	0	350'000
CH1148728178	3/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-32 Series 542	400'000	2'570'000
CH1148728269	0.65 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-31 Series 545	400'000	1'320'000
CH1148728277	3/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-37 Series 546	0	700'000
CH1151526154	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-31 Series 710	0	1'810'000
CH1151526196	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-37 Series 712	300'000	1'150'000
CH1151526238	0.45 % Andean Development Corp. 22-27 NT	100'000	730'000
CH1154887157	0.6025 % Lloyds Banking Group 22-29	200'000	1'000'000
CH1160382896	0.22 % Credit Agricole next bank (Suisse) 22-28	300'000	1'840'000
CH1160382979	1.285 % Macquarie Group 22-29	250'000	1'170'000
CH1163572915	3/8 % Berlin Hyp 22-25	0	350'000
CH1163572931	0.525 % Province of Saskatchewan 22-32	0	380'000
CH1166151907	3/4 % Roche Kapitalmarkt 22-31	250'000	1'500'000
CH1166151949	3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-35 Series 715	700'000	3'030'000
CH1166151972	1/2 % Hypo Vorarlberg Bank 22-27	250'000	780'000
CH1167887277	0.8975 % NatWest Markets 22-25 NT	200'000	1'200'000
CH1170565621	1/4 % ZKB 22-28 Series 154	350'000	990'000
CH1170565662	0.90 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-33 Series 548	200'000	1'390'000
CH1170565670	1 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-37 Series 549	0	430'000
CH1170565720	1.30 % Banque Cantonale de Neuchatel 22-32	0	170'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH1170565803	1.40 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-32 Series 551	1'200'000	4'020'000
CH1170565811	1.45 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-42 Series 552	0	1'390'000
CH1174335724	0.235 % Nederlandse Waterschapsbank 22-27	1'000'000	350'000
CH1174335781	1 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-30 Series 716	500'000	2'960'000
CH1174335815	0.545 % Kommunalbanken 22-28	0	490'000
CH1175016125	1.70 % Digital Intrepid Holding 22-27	150'000	770'000
CH1177791840	3/4 % Stadt Zuerich 22-31	150'000	700'000
CH1179184416	0.89 % Compagnie de Financement Foncier 22-29	3'000'000	1'950'000
CH1179534966	1.70 % Grande Dixence 22-29	200'000	830'000
CH1179534982	1 3/8 % New York Life Global Funding 22-28 NT	200'000	970'000
CH1179535013	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-32 Series 718	750'000	3'130'000
CH1179535021	1 5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-38 Series 719	500'000	2'190'000
CH1181713616	1.0625 % First Abu Dhabi Bank 22-26 NT	0	450'000
CH1182086848	1.65 % Kantonsspital Aarau 22-37	180'000	570'000
CH1184694714	1 1/4 % Svenska Handelsbanken 22-27 NT	120'000	700'000
CH1184694730	1.1675 % DNB Bank 22-27	150'000	1'130'000
CH1184694748	0.78 % Akademiska Hus 22-28 NT	0	350'000
CH1184694763	1.3275 % Banco Santander 22-25 NT	200'000	770'000
CH1184694789	1 1/2 % SpareBank 1 SMN 22-27 NT	200'000	240'000
CH1187450817	1 1/2 % Banque Federative du Credit Mutuel 22-27	115'000	780'000
CH1187520460	1.4604 % Credit Agricole 22-27 NT	0	700'000
CH1189217719	1.30 % % Graubuendner KB 22-30	250'000	1'480'000
CH1189217768	1.70 % Kantonsspital Baselland 22-32	200'000	1'110'000
CH1189217784	1.10 % Swissgrid 22-27	250'000	910'000
CH1189217826	1 1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-29 Series 553	300'000	3'270'000
CH1189217834	1.70 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-32 Series 554	650'000	2'660'000
CH1189217842	1.90 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-42 Series 555	400'000	1'620'000
CH1189217909	1.65 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-32 Series 557	4'000'000	2'780'000
CH1189217917	1.80 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-36 Series 558	650'000	1'970'000
CH1189217925	1.40 % ZKB 22-29	100'000	350'000
CH1191066187	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-33 Series 720	700'000	3'370'000
CH1191066237	1 1/2 % Stadt Zuerich 22-52	200'000	520'000
CH1191066245	0.80 % Asian Development Bank 22-27 NT	0	280'000
CH1191066278	1.5462 % CABEL 22-26 NT	200'000	1'290'000
CH1193213027	1 1/2 % Kanton Basel-Stadt 22-28	0	350'000
CH1193213076	1 3/4 % Basler KB 22-29 Series 1	1'000'000	1'390'000
CH1193213142	2.10 % Basler KB 23-33	5'000'000	1'740'000
CH1194000316	1.81 % Nordea Bank 22-27 NT	200'000	200'000
CH1194355066	2 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-37 Series 722	1'000'000	1'740'000
CH1194355074	2 1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-52 Series 723	2'500'000	870'000
CH1194355116	2 1/8 % Nestle 22-30	150'000	400'000
CH1194355124	2 1/2 % Nestle 22-34	200'000	1'040'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH1195555409	1 1/4 % Muenchener Hypothekenbank 22-27	1'150'000	1'740'000
CH1196217017	2 5/8 % Romande Energie Holding 22-37	500'000	2'510'000
CH1199322384	0.9194 % Nationwide Building Society 22-25 Tranche 1	250'000	1'510'000
CH1199659934	2.15 % Metropolitan Life Global Funding 22-26 Reg S	0	540'000
CH1199659975	1 7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-38 Series 725	1'000'000	1'740'000
CH1202242249	0.9675 % Berlin Hyp 22-26	2'500'000	870'000
CH1204175124	1.915 % Nationwide Building Society 22-28 NT	350'000	1'840'000
CH1204259738	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-32 Series 726	300'000	1'150'000
CH1204259746	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-42 Series 727	750'000	2'350'000
CH1204259795	1.0225 % Swedisch Export Credit 22-27 Tranche 1 Reg S	150'000	1'250'000
CH1204259811	1.95 % Deutsche Bahn Finance 22-32 NT	300'000	960'000
CH1206367422	1.85 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-37 Series 560	600'000	3'690'000
CH1206367463	1.95 % Groupe E 22-27	200'000	450'000
CH1206367471	2.55 % Groupe E 22-32	0	520'000
CH1206367497	3 3/4 % dormakaba Finance 22-27	200'000	830'000
CH1206367596	2.35 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-37 Series 565	2'550'000	1'040'000
CH1206367638	1.85 % ZKB 22-27 Series 157	550'000	2'450'000
CH1206367679	1.45 % Kanton Zuerich 22-29	250'000	1'030'000
CH1209697551	1 1/4 % Thurgauer KB 22-29	350'000	1'230'000
CH1210198128	2.08 % Corporacion Andina De Fomento 22-28	1'100'000	1'430'000
CH1211713156	1.6075 % Credit Agricole next bank (Suisse) 22-27	1'000'000	700'000
CH1211713164	1.97 % Credit Agricole next bank (Suisse) 22-32	250'000	1'220'000
CH1212189133	1.68 % Akademiska Hus 22-32 NT	450'000	1'230'000
CH1212189158	2 3/4 % LGT Bank 22-32	0	480'000
CH1213243913	3.0425 % Credit Agricole 22-27 NT	200'000	600'000
CH1214797131	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 33-34 Series 728	0	350'000
CH1214912029	2.05 % Luzerner KB 22-47	1'100'000	1'080'000
CH1216400049	2.87 % BAWAG 22-25	150'000	640'000
CH1216400056	2.155 % Korea Housing Finance 22-25	130'000	520'000
CH1216400064	2.465 % Korea Housing Finance 22-27	130'000	610'000
CH1216400080	1.66 % Auckland Council 22-27 NT	100'000	660'000
CH1217066583	1 7/8 % Basler KB 23-29	150'000	750'000
CH1217066591	2 % Basler KB 23-34	300'000	800'000
CH1218301955	2 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-32 Series 730	5'250'000	1'830'000
CH1218301963	2 1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-37 Series 731	400'000	1'560'000
CH1226543838	2 1/4 % Nestle 22-29	150'000	730'000
CH1226543846	2 5/8 % Nestle 22-35	150'000	780'000
CH1227937708	2.5025 % E.ON 22-29	100'000	380'000
CH1227937716	2.4125 % BNP Paribas 23-28 NT	400'000	2'200'000
CH1227937724	2.2475 % Banco Santander 23-26 Series 176 NT	200'000	1'110'000
CH1227937732	1 5/8 % Kommunekredit 23-30 NT	5'800'000	1'670'000
CH1228837865	2.33 % UBS AG, London Branch 22-25 NT	200'000	800'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH1228837899	2.4075 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 22-25 NT	100'000	800'000
CH1228837907	2.77 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 22-28	200'000	700'000
CH1228838129	2.285 % Deutsche Bahn Finance 22-42 NT	150'000	700'000
CH1230759537	1.275 % Kommunalbanken 22-27	250'000	570'000
CH1230759560	1.95 % Inselspital-Stiftung 23-26	350'000	1'690'000
CH1231094355	2 1/8 % Luzerner KB 23-32	300'000	1'500'000
CH1231094363	1.96 % BAWAG P.S.K. Versicherung 23-31	2'500'000	870'000
CH1231094371	1.70 % Stadt Bern 23-33	0	520'000
CH1231094389	1.90 % Luzerner KB 23-31	4'500'000	1'570'000
CH1231094397	2 % Luzerner KB 23-38	5'000'000	1'740'000
CH1231312674	1 3/4 % Caisse des Depots et Consignations 22-29 NT	200'000	1'000'000
CH1231312682	2.1375 % CABEI 22-27	250'000	990'000
CH1231312708	2.7825 % NatWest Markets 22-27 NT	200'000	800'000
CH1232107024	1 1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-27 Series 566	2'000'000	700'000
CH1232107032	1.70 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-30 Series 567	0	1'390'000
CH1232107131	2.05 % BCV 23-28	400'000	1'790'000
CH1233900005	1 7/8 % Muenchener Hypothekenbank 23-30	5'000'000	2'430'000
CH1233900013	2 3/8 % Hypo Vorarlberg Bank 23-26	250'000	610'000
CH1236363409	1.7575 % Nationwide Building Society 23-26	225'000	430'000
CH1236363417	2.0125 % Nationwide Building Society 23-30	150'000	1'040'000
CH1239464550	1.90 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-38 Series 569	1'600'000	1'950'000
CH1239464568	2.10 % Ville de Lausanne 23-48	300'000	700'000
CH1239464634	2 1/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-38 Series 570	3'500'000	1'220'000
CH1239464667	2.20 % Stadt Winterthur 23-58	150'000	490'000
CH1239464691	3 % Allreal Holding 23-28	0	730'000
CH1239464725	2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-29 Series 571	5'000'000	1'740'000
CH1239464733	2.05 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-32 Series 572	5'000'000	1'740'000
CH1239464782	2.05 % Banque Cantonale de Neuchatel 23-28	750'000	260'000
CH1239464790	2.05 % Banca dello Stato del Cantone Ticino 23-30	2'250'000	780'000
CH1239494979	1.7125 % Aktiebolaget Svensk Exportkredit 23-30	300'000	1'160'000
CH1239494987	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-29 Series 732	1'000'000	2'090'000
CH1239494995	1 7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-33 Series 733	450'000	1'980'000
CH1242969199	2.30 % Banque Federative du Credit Mutuel 23-27 NT	150'000	570'000
CH1243018806	2.745 % Lloyds Banking Group 23-27 NT	400'000	1'800'000
CH1243651903	2.4113 % Cembra Money Bank 23-29	350'000	1'010'000
CH1243651929	2 1/2 % LGT Bank 23-33 NT	300'000	470'000
CH1243651945	2 3/4 % Kraftwerke Linth-Limmern 23-30	225'000	720'000
CH1243651952	1 7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-31 series 734	500'000	2'260'000
CH1243933574	1.815 % Korea Housing Finance 23-26	550'000	1'830'000
CH1243933582	1.8925 % Korea Housing Finance 23-28 Tranche 2	0	520'000
CH1243933590	2.4275 % Corporacion Andina de Fomento 23-30	550'000	990'000
CH1244321761	2.63 % BNP Paribas 23-29 NT	1'600'000	600'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH1244321779	1 5/8 % Municipality Finance 23-28 NT	4'500'000	1'570'000
CH1244321803	1 1/2 % Nordic Investment Bank 23-28 NT	4'000'000	1'390'000
CH1244731753	2 5/8 % DZ BANK AG 23-29	400'000	1'200'000
CH1244731795	2 1/8 % Berlin Hyp 23-26	350'000	1'900'000
CH1245295758	3.2625 % Commerzbank 23-27 NT	300'000	1'500'000
CH1248666955	2.6175 % Societe Generale 23-30 NT	250'000	780'000
CH1248666963	2.8925 % Banco de Credito e Inversiones 23-28 NT	150'000	700'000
CH1249151049	1 3/4 % Caisse des Depots et Consignations 23-31 NT	600'000	1'800'000
CH1249416004	2.5413 % Credit Agricole 23-30	300'000	800'000
CH1249416012	2.70 % SpareBank 1 Nord-Norge 23-29 NT	200'000	400'000
CH1249416020	1.9925 % Akademiska Hus 23-33 NT	0	820'000
CH1249416038	2 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-26 Series 735	400'000	2'090'000
CH1251030099	2 5/8 % ABN AMRO Bank 23-28	200'000	400'000
CH1251030107	1.903 % Compagnie de Financement Foncier 23-28	300'000	1'720'000
CH1255924404	2.70 % Ferring Holding 23-27	900'000	3'790'000
CH1255924412	3 1/4 % Ferring Holding 23-31	400'000	2'080'000
CH1255924420	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-33 Series 738	0	1'040'000
CH1255924438	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-38 Series 739	4'850'000	3'430'000
CH1255924461	2.65 % Massmutual Global Funding II 23-28 Series 2023-4	2'000'000	700'000
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 23-28	0	520'000
CH1256367181	1.7925 % BNG Bank 23-28 NT	0	1'270'000
CH1256367207	2.5075 % Credit Agricole 23-27 NT	2'500'000	870'000
CH1261608900	2.8325 % DZ BANK AG 23-29	1'600'000	600'000
CH1264414322	3.80 % Commerzbank 23-28 NT	4'000'000	1'400'000
CH1264823431	2.04 % Province of Quebec 23-33	3'440'000	1'200'000
CH1264823480	2.385 % UBS AG, London Branch 23-25	4'000'000	1'400'000
CH1264823498	2.55 % UBS AG, London Branch 23-29	4'600'000	1'600'000
CH1264823506	1.6875 % BNG Bank 23-30 NT	4'800'000	1'670'000
CH1264823514	2.49 % Nordea Bank 23-28 NT	1'400'000	600'000
CH1266847073	2.55 % Kantonsspital Baden 23-38	2'400'000	970'000
CH1266847107	1.70 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-28 Series 574	2'500'000	870'000
CH1266847156	1.90 % Swissgrid 23-26	1'000'000	350'000
CH1266847172	2.40 % KEBAG 23-38	2'000'000	1'020'000
CH1266847214	1.85 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-31 Series 575	5'000'000	1'740'000
CH1266847255	1.80 % Banque Cantonale du Valais 23-29	4'000'000	1'390'000
CH1266847271	1.85 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-33 Series 578	5'000'000	1'740'000
CH1266847289	1.85 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-38 Series 579	6'000'000	2'090'000
CH1267329279	2.10 % BCV 23-32	5'100'000	2'170'000
CH1268922189	1.825 % Credit Agricole Home Loan SFH 23-28	5'200'000	1'810'000
CH1268922205	2 7/8 % OC Oerlikon Corporation 23-26	3'000'000	1'040'000
CH1270609485	1.85 % Valiant 28 23-28	5'000'000	1'740'000
CH1270825545	2.8575 % NatWest Markets 23-28	2'200'000	800'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés



ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH1271360401	2.7725 % Swedbank 23-28 NT	2'000'000	800'000
CH1271360419	1.8425 % Akademiska Hus 23-35	2'500'000	870'000
CH1271360567	1 5/8 % Credit Agricole next bank (Suisse) 22-29	5'000'000	1'740'000
CH1271360583	1.81 % Kommunalbanken 23-30 nt	2'400'000	830'000
CH1271360609	1.6275 % NRW Bank 23-28 NT	5'000'000	1'740'000
CH1271360625	2 7/8 % Equinix 23-28	3'000'000	1'040'000
CH1271360633	2.1725 % Korea Water Resources 23-25	4'950'000	1'720'000
CH1273475397	1 7/8 % Nestle 23-29	2'600'000	1'560'000
CH1273475405	2 % Nestle 23-33	4'500'000	2'540'000
CH1273475413	2 1/8 % Nestle 23-38	3'750'000	2'280'000
CH1273475421	2.30 % ABN AMRO Bank 23-25 Tranche 1 NT	4'400'000	1'600'000
CH1274703110	1.8984 % Credit Agricole next bank (Suisse) 23-26	1'000'000	350'000
CH1276269722	2.505 % ABN AMRO Bank 23-28 Tranche 2 NT	1'200'000	400'000
CH1276269730	2.73 % Banque Federative du Credit Mutuel 23-30 NT	4'980'000	1'730'000
CH1276269755	2.7325 % Santander Consumer Finance 23-25 NT	2'600'000	900'000
CH1276313256	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-40 Series 740	10'000'000	3'480'000
CH1276313314	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-33 Series 742	7'000'000	2'430'000
CH1276313322	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-38 Series 743	5'000'000	1'740'000
CH1277028440	1.985 % SNCF 23-33 NT	2'600'000	900'000
CH1277080508	1.885 % Deutsche Bahn Finance 23-35	3'200'000	700'000
CH1277240938	2.7725 % La Banque Postale 23-27 NT	5'000'000	1'700'000
CH1277582008	2.34 % ENGIE 23-27 NT	3'790'000	1'320'000
CH1279261148	1.8375 % CFF 23-30 NT	7'000'000	2'430'000
CH1279261155	2.2225 % The Korea Development Bank 23-26 NT	4'050'000	1'410'000
CH1279261163	1.70 % Stadt Zuerich 23-44	3'900'000	1'360'000
CH1280154290	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-43 Series 744	5'440'000	1'890'000
CH1280154308	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-33 Series 745	2'000'000	0
CH1280155461	1.80 % St Galler KB 23-33	3'000'000	1'040'000
CH1280994281	1.87 % Lloyds Bank 23-27	5'720'000	1'990'000
CH1280994299	2.97 % Nationwide Building Society 23-27	3'000'000	1'000'000
CH1289657095	1 7/8 % Hypo Vorarlberg Bank 23-30	3'900'000	1'360'000
CH1289657111	2 % Emmi Finanz 23-28	2'000'000	0
CH1290222285	2 3/8 % Bank Julius Baer & Co, Guernsey Branch 23-27	2'000'000	700'000
CH1290222301	2.40 % Kantonsspital St. Gallen 23-33	3'850'000	990'000
CH1290222319	2 1/2 % Kantonsspital St. Gallen 23-38	5'000'000	1'220'000
CH1290222418	1 3/4 % Stadt Zuerich 23-41	2'150'000	0
CH1290975528	1.90 % Banque Cantonale de Fribourg 23-26	4'000'000	1'390'000
CH1292012775	2.01 % Santander UK 23-26 Series 82	3'680'000	1'280'000
CH1293237975	1.965 % ABB 23-26	1'400'000	490'000
CH1293238007	2.2025 % DZ BANK 23-28	2'500'000	870'000
CH1293714346	2 1/4 % Partners Group 23-28	2'300'000	800'000
CH1293714361	2 3/8 % Inselspital-Stiftung 23-31	3'000'000	1'040'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH1293714379	2.52 % Inselspital-Stiftung 23-38	1'000'000	0
CH1294486357	2.3625 % Credit Agricole 23-28 NT	1'500'000	0
CH1294486365	3.61 % DZ BANK 23-28	1'600'000	0
CH1296276152	2.47 % Achmea Bank 23-26 NT	2'400'000	0

### Positions fermées en cours de période comptable

#### Obligations

CH0025826949	3 1/4 % SNCF Reseau 06-32 NT	35'000	35'000
CH0026233491	3 1/4 % NWB 06-29 NT	60'000	60'000
CH0030653916	3 % Eurofima 07-24	0	300'000
CH0033037679	3 1/2 % Rabobank Nederland 07-23 NT	200'000	900'000
CH0111008048	2 5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 10-30 Series 512	300'000	300'000
CH0114695403	1 3/4 % Kanton Bern 10-25	100'000	100'000
CH0116306868	2 % ZKB 10-25 Series 114	150'000	150'000
CH0116403517	2 % DNB Boligkredit 10-30 NT	150'000	150'000
CH0116712644	2 % Raiffeisen Suisse 10-23	0	600'000
CH0125067774	2 5/8 % SNCF Reseau 11-37 NT	70'000	70'000
CH0127350376	2 3/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 11-26 Series 410	200'000	200'000
CH0130501304	2 3/4 % KW Linth-Limmern 11-23	300'000	2'250'000
CH0132176055	2 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 11-25 Series 554	150'000	150'000
CH0136847156	1 3/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 11-26 Series 413	200'000	600'000
CH0140819845	1 5/8 % Stadt St Gallen 11-25	100'000	100'000
CH0149176171	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 12-40 Series 565	100'000	100'000
CH0180006113	1 5/8 % EIB 12-26	200'000	200'000
CH0182337334	1 7/8 % Stadt Winterthur 12-37	100'000	100'000
CH0186162613	1 % Stadt Zuerich 12-23	200'000	200'000
CH0188335365	1 3/4 % Swisscom 12-24	300'000	900'000
CH0194695117	1 % Kanton Bern 12-24	200'000	200'000
CH0203872863	1 1/8 % ZKB 13-24 Series 129	100'000	4'400'000
CH0205500017	1 3/4 % Stadt Lugano 13-43	150'000	150'000
CH0210240310	1 3/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 13-25 Series 432	100'000	100'000
CH0210362791	1 1/2 % Flughafen Zuerich 13-23	0	1'455'000
CH0212184078	1 7/8 % Swiss Life Holding 13-23	250'000	250'000
CH0212937251	1 3/8 % Deutsche Bahn Finance 13-23 NT	0	2'500'000
CH0214926088	1 5/8 % Emmi Finanz 13-23	200'000	7'185'000
CH0217850681	1 5/8 % Kanton Zuerich 13-26	100'000	100'000
CH0222705987	1 7/8 % Zuerich Versicherungs Gesellschaft 13-23 NT	0	1'500'000
CH0224761517	1 7/8 % Sika 13-23	150'000	350'000
CH0225071593	1 7/8 % Hilti 13-23	100'000	400'000
CH0227678973	1 3/8 % Ville de Lausanne 13-23	150'000	150'000
CH0236122740	1 3/4 % SGS 14-24	300'000	3'200'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0236669591	1 1/4 % Kanton Zuerich 14-24	100'000	100'000
CH0236686843	1 3/8 % Thurgauer KB 14-23	100'000	100'000
CH0239312207	1 1/2 % BCV 14-24	320'000	320'000
CH0239713297	1 1/4 % Kanton Bern 14-24	100'000	100'000
CH0240109774	1 5/8 % Engadiner Kraftwerke 14-24	0	1'050'000
CH0241528741	1 1/4 % BNG Bank 14-24	200'000	3'200'000
CH0247754382	1 5/8 % Canton de Geneve 14-29	100'000	100'000
CH0249483683	1 % Cie Suisse de Reassurances 14-24 NT	0	250'000
CH0252903726	1 % Kanton Baselland 14-27	200'000	200'000
CH0253612581	1 % Stadt Zuerich 14-27	200'000	200'000
CH0255475292	1 % Lindt & Spruengli 14-24	0	400'000
CH0255893072	1/2 % Credit Agricole Home Loan 15-27 NT	100'000	100'000
CH0255893122	1 1/2 % Helvetia Compagnie Suisse d'Assurances 14-25	145'000	145'000
CH0260769424	1 3/8 % AT&T 14-24	0	400'000
CH0262085076	7/8 % Aargauische KB 15-30	100'000	100'000
CH0262881441	3/4 % Cie Suisse de Reassurances 15-27	0	500'000
CH0262881458	1 % PSP Swiss Property 15-25	200'000	200'000
CH0266842704	1 % Credit Agricole 15-25 NT	0	100'000
CH0267855994	5/8 % Kanton Baselland 15-36	100'000	100'000
CH0273485380	3/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-25 Series 461	200'000	200'000
CH0276237663	0.30 % Geberit 15-23	0	365'000
CH0279135310	1/4 % SGS 15-23	0	750'000
CH0279135328	7/8 % SGS 15-30	200'000	200'000
CH0281835485	3/8 % Kanton Thurgau 15-25	100'000	100'000
CH0282857868	1/4 % Kanton Baselland 15-24	100'000	100'000
CH0282857876	3/4 % Kanton Baselland 15-32	100'000	100'000
CH0284687420	1 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-42 Series 615	100'000	100'000
CH0292086193	0.45 % Corporacion Andina De Fomento 15-23 NT	0	850'000
CH0299477361	5/8 % LGT Bank 15-25	0	300'000
CH0300874267	1/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-24 Series 470	700'000	1'290'000
CH0303925652	0.55 % BFCM 15-23 NT	350'000	5'750'000
CH0305557644	1/2 % DH Switzerland Finance 15-23	100'000	2'450'000
CH0306179125	1 % Holcim 15-25	150'000	150'000
CH0310175598	0.10 % Credit Agricole Home Loan 16-26	100'000	100'000
CH0312512681	5/8 % Bell Food Group 16-25	100'000	600'000
CH0315593928	0.40 % Canton de Geneve 16-36	100'000	100'000
CH0315955903	0.304 % Corporacion Andina De Fomento 16-24	100'000	100'000
CH0317921663	3/8 % Swisscom 16-28	120'000	3'120'000
CH0319403744	0.05 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-26 Series 480	200'000	200'000
CH0319403751	1/8 % ZKB 16-26 Series 138	200'000	200'000
CH0319415987	1/2 % Coop-Gruppe Genossenschaft 16-26	175'000	775'000
CH0323735628	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-27 Series 631	200'000	200'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0325429188	3/8 % Vodafone Group 16-24 NT	0	400'000
CH0326213953	3/4 % Kinderspital Zuerich - Eleonorenstiftung 16-36	100'000	100'000
CH0336352759	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-40 Series 636	100'000	100'000
CH0336352775	1/8 % Swisscom 16-32	150'000	150'000
CH0336587644	0.02 % Aargauische KB 16-24	200'000	200'000
CH0336587669	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-24 Series 482	200'000	200'000
CH0338330423	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-43 Series 640	160'000	160'000
CH0343366792	0.05 % Kanton Bern 16-31	200'000	200'000
CH0347082783	1/4 % ZKB 17-26 Series 141	100'000	100'000
CH0347082809	0.30 % Banque Cantonale de Fribourg 17-27	100'000	100'000
CH0347556901	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-25 Series 643	0	650'000
CH0352595927	0.55 % SGS 17-26	0	2'000'000
CH0353688929	0.11 % Aargauische KB 17-24	0	1'000'000
CH0361532879	5/8 % Flughafen Zuerich 17-29	100'000	100'000
CH0361533067	1/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 17-25 Series 496	175'000	675'000
CH0364277415	5/8 % Stadt Bern 17-39	150'000	150'000
CH0365501516	5/8 % UBS Group Funding (Switzerland) 17-24	0	3'000'000
CH0367206684	3/4 % Banco Santander 17-23	0	1'500'000
CH0367206742	0.70 % Lonza Swiss Finanz 17-24	200'000	1'200'000
CH0372831534	1 1/8 % Banco Santander 17-27 NT	245'000	3'115'000
CH0372831567	1/2 % BCV 17-29	100'000	100'000
CH0373476073	3/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 17-28 Series 497	200'000	200'000
CH0373476107	0.70 % Stadt Zuerich 17-39	100'000	100'000
CH0373476214	3/8 % Julius Baer Groupe 17-24	0	550'000
CH0373476628	1/2 % Allreal Holding 18-23	100'000	1'400'000
CH0373476768	1 1/4 % Grande Dixence 18-23	100'000	400'000
CH0379268698	0.30 % Lindt & Spruengli 17-27	200'000	200'000
CH0383104335	1/4 % Nestle 17-27	225'000	625'000
CH0384125065	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-26 Series 654	140'000	140'000
CH0384629892	1 % dormakaba Finance 17-25	100'000	1'600'000
CH0385997090	1/4 % Cembra Money Bank 17-24	0	500'000
CH0385997108	0.45 % Deutsche Bahn Finance 17-30 NT	100'000	100'000
CH0386949314	0.55 % Muenchener Hypothekenbank 17-32	95'000	95'000
CH0391911770	3/8 % Banque Valiant 17-27	140'000	140'000
CH0392885809	3/8 % Banca dello Stato del Cantone Ticino 18-28	300'000	300'000
CH0394905704	1/8 % Basler KB 18-24	600'000	600'000
CH0394905712	0 % Kanton Basel-Stadt 18-25	100'000	100'000
CH0398633252	1 % Swiss Prime Site Finance 18-24	0	300'000
CH0398633369	0.35 % Banque Cantonale de Neuchatel 18-26	190'000	190'000
CH0398633450	7/8 % Mobimo Holding 18-23	0	300'000
CH0398633534	1 1/4 % SGS 18-28	115'000	115'000
CH0398633542	1 % Zurich Compagnie d'Assurances 18-28	145'000	145'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0398633567	1/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 18-24 Series 506	400'000	400'000
CH0398678901	3/8 % Bell Food Group 18-24	300'000	4'600'000
CH0400971617	0.35 % Raiffeisen Suisse 18-24	100'000	100'000
CH0401956864	0.45 % Hypo Vorarlberg Bank 18-24 NT	100'000	100'000
CH0406415247	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-24 Series 658	0	2'000'000
CH0407809760	3/8 % Givaudan 18-25	0	500'000
CH0407809778	0.366 % Banque Federative du Credit Mutuel 18-24 NT	145'000	145'000
CH0409606362	1 % Transurban Queensland Finance Pty 18-25 NT	0	400'000
CH0417086078	0.303 % The Korea Development Bank 18-23 NT	0	780'000
CH0419040776	0.70 % Stadt Bern 19-34	60'000	60'000
CH0419040784	1/4 % Basellandschaftliche KB 19-27	0	100'000
CH0419040792	3/4 % Zurich Compagnie d'Assurances 19-27 NT	200'000	200'000
CH0419041154	0.35 % Kanton Bern 19-34	250'000	250'000
CH0419041212	0.44 % Ste Coop Centr. const. logements 19-37 Series 61	50'000	50'000
CH0419041220	0.55 % PSP Swiss Property 19-28	100'000	100'000
CH0419041246	1/8 % Deutsche Pfandbriefbank 19-23 Reg S	250'000	3'450'000
CH0419041287	0.40 % Partners Group Holding 19-27	160'000	560'000
CH0419041345	0 % Cembra Money Bank 19-23	350'000	4'970'000
CH0419041501	0.05 % Swissgrid 19-50	60'000	60'000
CH0419042533	1.30 % Sulzer 18-23	0	2'500'000
CH0429659607	1 % Lloyds Banking Group 18-25 NT	50'000	1'155'000
CH0429659623	0.15 % Korea Water Resources 18-23 NT	150'000	1'985'000
CH0433761274	1 % Holcim 18-24 NT	300'000	2'500'000
CH0433761308	1/4 % Roche Kapitalmarkt 18-25	200'000	200'000
CH0434678428	1.60 % Sulzer 18-24	200'000	500'000
CH0443027047	0.15 % Aargauische KB 18-24	0	230'000
CH0443057515	1/2 % Thurgauer KB 18-26	100'000	100'000
CH0444153792	1/2 % Aargauische KB 18-27	150'000	150'000
CH0446595677	0.30 % Canton de Geneve 18-26	200'000	200'000
CH0457206784	0.45 % Credit Agricole Home Loan 19-29	100'000	100'000
CH0461238864	3/8 % Stadler Rail 19-26	90'000	1'890'000
CH0461238914	0.35 % Swiss Life Holding 19-29	60'000	60'000
CH0461239037	0.05 % Basler KB 19-33	0	150'000
CH0463112059	0.55 % Muenchener Hypothekenbank 19-34	100'000	100'000
CH0463112067	0.05 % DNB Bank 19-24	150'000	2'300'000
CH0465044680	0.401 % First Abu Dhabi Bank 19-24 NT	30'000	30'000
CH0465767785	0.384 % Banco Santander Chile 19-24 NT	0	300'000
CH0467182389	7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-40 Series 669	200'000	200'000
CH0471297918	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-24 Series 670	0	5'000'000
CH0474977755	1/8 % SpareBank 1 Nord-Norge 19-25	150'000	350'000
CH0483180920	1 % Banque Intl a Luxembourg 19-25 NT	150'000	150'000
CH0483180953	0.20 % ORANGE 19-25 NT	0	500'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0488506681	3/8 % Swiss Prime Site Finance 19-31	0	400'000
CH0494734400	0.05 % Ville de Lausanne 19-54	30'000	30'000
CH0494734426	0.10 % Zug Estates Holding 19-25	100'000	100'000
CH0498400602	1/4 % Societe Generale 19-26 NT	200'000	200'000
CH0498589024	1/4 % Credit Agricole 19-29 NT	270'000	270'000
CH0502393355	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-26 Series 680	400'000	400'000
CH0505011962	0.45 % Black Sea Trade & Development Bank 19-23 NT	400'000	5'390'000
CH0506071353	0 % Banque Cantonale de Fribourg 21-31	100'000	100'000
CH0508785737	0.15 % Santander Consumer Finance 19-24 NT	100'000	300'000
CH0517825292	0.20 % Banque Federative du Credit Mutuel 20-28 NT	200'000	200'000
CH0522158846	1/4 % St Galler KB 21-35	250'000	250'000
CH0522158879	0.10 % Banque Valiant 21-31	150'000	150'000
CH0536893602	1 % Straumann Holding 20-23	350'000	4'235'000
CH0538763522	3/4 % Coop-Gruppe Genossenschaft 20-23	400'000	5'695'000
CH0539032927	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-28 Series 688	100'000	100'000
CH0545766609	0.05 % Hilti 20-25	65'000	965'000
CH0547243268	1/2 % Sonova Holding 20-25	200'000	200'000
CH0547243276	3/4 % Sonova Holding 20-28	200'000	4'010'000
CH0564642087	1/4 % Lindt & Spruengli 20-32	100'000	400'000
CH0572899091	0.1825 % Raiffeisen Suisse 20-25	200'000	200'000
CH0593093211	1/8 % KW Oberhasli 21-31	100'000	100'000
CH0593893974	0 % Kommunekredit 21-42 NT	0	100'000
CH1101096555	1/8 % Bank Julius Baer & Co 21-28	0	500'000
CH1105672658	0.1925 % Verizon Communications 21-28	100'000	100'000
CH1105672666	0.555 % Verizon Communications 21-31	100'000	2'000'000
CH1112455790	3/8 % OC Oerlikon Corporation 21-25	150'000	1'550'000
CH1120085670	0.15 % UBS AG, London Branch 21-28	200'000	1'300'000
CH1127263973	1/8 % Holcim Helvetia Finance 21-27 NT	0	600'000
CH1131931284	0.35 % Kantonsspital Baden 21-36	100'000	100'000
CH1132966297	0.03 % Credit Agricole next bank (Suisse) 21-31	150'000	150'000
CH1132966347	0.20 % SIX Group 21-29	100'000	2'000'000
CH1138869784	1/8 % Basellandschaftliche KB 21-31	100'000	100'000
CH1166151923	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-27 Series 714	500'000	500'000
CH1179184424	0.94 % The Korea Development Bank 22-27 NT	0	200'000
CH1206367554	3.1125 % Cembra Money Bank 22-27	0	300'000
CH1206367570	1 5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-26 Series 563	600'000	600'000
CH1211713222	1 1/2 % Roche Kapitalmarkt 22-26	150'000	150'000
CH1211713230	2 % Roche Kapitalmarkt 22-32	150'000	150'000
CH1214797206	2.3775 % Adecco Group 22-27 NT	150'000	2'000'000
CH1223665063	3.35 % Sulzer 22-26	0	800'000
CH1228837881	1.515 % DBS Bank 22-25	450'000	6'950'000
CH1232107172	1 5/8 % Stadt Lugano 23-29	100'000	100'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH1242301278	2.2588 % Swiss Life Holding 23-28	0	1'530'000
CH1242301286	2.61 % Swiss Life Holding 23-32	200'000	2'000'000
CH1249416087	2.30 % Geberit 23-32	100'000	2'550'000
CH1255924396	2 % Usines Electriques de l'Engadine 23-30	0	500'000
CH1264414348	2.13 % Toyota Motor Finance 23-27	1'500'000	1'500'000
CH1264887352	2 5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 11-31 Series 548	9'300'000	9'300'000
CH1264887360	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-38 Series 739	1'350'000	1'350'000
CH1266847115	1.65 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-32 Series 557	400'000	400'000
CH1274703136	2.05 % Luzerner KB 23-47	900'000	900'000
CH1280154282	2 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-32 Series 730	5'250'000	5'250'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options

2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

## Notes aux états financiers

### Commissions

AMC PROFESSIONAL FUND – BCV Swiss Franc Bonds ESG	Commission de gestion forfaitaire annuelle appliquée à la charge de la fortune du fonds	Commissions à la charge de l'investisseur	
		Indemnité pour frais accessoires en faveur de la fortune du fonds	
		A l'émission	Au rachat
Classe B	0.30%*	Max. 0.80%	
Classe C	0.25%*		
Classe Z	0.03%*		

\* En cas d'investissement dans des fonds cibles liés (tels que définis dans le contrat de fonds), la direction du fonds peut décider de prélever une commission de gestion forfaitaire réduite

Dans les limites du contrat de fonds, la direction du fonds et ses mandataires peuvent payer des rétrocessions pour indemniser les activités de promotion de la vente. Ils n'accordent aucun rabais pour réduire les frais et coûts revenant aux investisseurs et imputés au fonds.

La direction du fonds n'a pas conclu de Soft Commission Agreements.

Le taux maximum de la commission de gestion des fonds cibles dans lesquels le fonds peut investir est de 3%.

### Calcul et évaluation de la valeur nette d'inventaire

La valeur nette d'inventaire d'une part d'une classe du fonds est déterminée à la fin de l'exercice comptable et chaque jour où des parts sont émises ou rachetées. Les jours où les bourses ou marchés des principaux pays de placement du fonds sont fermés (par exemple, jours bancaires et boursiers fériés), il n'est pas effectué de calcul.

La valeur nette d'inventaire d'une part d'une classe du fonds peut également être déterminée à des dates auxquelles des parts ne sont pas émises ou rachetées, à des fins de calculs et mesures de la performance ou de calculs de commissions exclusivement. Elle ne peut en aucun cas servir de base à des ordres de souscription ou de rachat de parts.

Les placements négociés en bourse ou sur un autre marché réglementé ouvert au public doivent être évalués selon les cours actuels payés sur le marché principal. Les autres placements ou les placements pour lesquels aucun cours du jour n'est disponible doivent être évalués au prix qui pourrait en être obtenu s'ils étaient vendus avec soin au moment de l'évaluation. Pour déterminer la valeur vénale, la direction du fonds utilise dans ce cas des modèles et des principes d'évaluation appropriés et reconnus dans la pratique.

Les placements collectifs de capitaux sont évalués à leur prix de rachat ou à leur valeur nette d'inventaire. S'ils sont négociés régulièrement en bourse ou sur un autre marché réglementé ouvert au public, la direction du fonds peut les évaluer selon le paragraphe ci-dessus. Si une valeur nette d'inventaire n'est pas disponible ou disponible uniquement sur une base estimative, la direction du fonds évalue cette valeur au prix probable réalisable avec diligence au moment de l'évaluation en utilisant des modèles et des principes d'évaluation appropriés et reconnus dans la pratique (Fair Value). Elle peut se baser sur des données fournies par les dépositaires, administrateurs ou gestionnaires des fonds cibles.

Les avoirs en banque sont évalués à hauteur du montant de la créance plus les intérêts courus. En cas de changements notables des conditions du marché ou de la solvabilité, la base d'évaluation des avoirs en banque à terme est adaptée aux nouvelles circonstances.

La valeur nette d'inventaire d'une part d'une classe du fonds résulte de la quote-part de la valeur vénale de la fortune du fonds attribuable à la classe en question, réduite d'éventuels engagements attribuables à cette classe, divisée par le nombre de parts en circulation de cette même classe. La valeur nette d'inventaire est arrondie à deux décimales.



## Rapport de performance

		2020	2021	2022	2023 au 30 sept.
Performance :					
– Classe A (lancée le 27.04.05, liquidée le 01.09.23)	%	0.31	-2.26	-11.97	3.19
– Classe B (lancée le 27.04.05)	%	0.61	-1.98	-11.71	3.41
– Classe C (lancée le 27.04.05)	%	0.65	-1.92	-11.66	3.43
– Classe Z (lancée le 10.01.19)	%	0.88	-1.71	-11.47	3.62

### Notes

1. La performance a été calculée et est publiée conformément à la directive de l'Asset Management Association Switzerland AMAS.
2. Le fonds n'ayant pas d'indice de référence, sa performance n'est pas comparée à un tel indice.
3. Les chiffres figurant dans le tableau ci-dessus sont calculés sur une base annuelle sauf pour l'année de lancement (le début de la période est indiqué dans ledit tableau) et pour l'année de clôture (la fin de la période correspond à la date du présent rapport).
4. La performance historique ne représente pas un indicateur de performance actuelle ou future. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais perçus lors de l'émission ou du rachat des parts.