

AMC PROFESSIONAL FUND - BCV Swiss Franc Bonds ESG

Rapport annuel au 31 mars 2024

Table des matières

Direction du fonds et organisation	2
Information aux investisseurs	3
Utilisation du revenu net	4
Chiffres comptables	5
Inventaire et transactions	10
Notes aux états financiers	53
Rapport de performance	55
Rapport abrégé de la société d'audit	56



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

www.bcv.ch/invest



Rue du Maupas 2
Case postale 691
CH-1001 Lausanne

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, telle que publiée sur la plateforme électronique 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 reprenneur) 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 reprenneur. 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.

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

3) Remboursement en nature 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.

4) Apport en nature

Le 13 octobre 2023, la direction du fonds a accepté un apport en nature aux conditions du § 18 du contrat du fonds. Le montant de l'apport en nature s'est élevé à CHF 76'434'147.10, équivalant à 825'511.903 parts de la classe Z à CHF 92.59 la part.

Utilisation du revenu net au 31 mars 2024

Date Ex VNI : 01/09/2023

Date de paiement : 05/09/2023

				Montant intermédiaire pour porteurs de parts domiciliés			
				en Suisse			à l'étranger
Classe	Affidavit	Coupon n°	Monnaie	Brut par part	Impôt anticipé fédéral moins 35%	Net par part	Net par part
Classe A	Non	17	CHF	0.13501	0.04725	0.08776	0.08776

Date Ex VNI : 13/09/2023

Date de paiement : 15/09/2023

				Montant intermédiaire pour porteurs de parts domiciliés			
				en Suisse			à l'étranger
Classe	Affidavit	Coupon n°	Monnaie	Brut par part	Impôt anticipé fédéral moins 35%	Net par part	Net par part
Classe Z	Non	6	CHF	0.53737432	0.18808	0.34929	0.34929

Date Ex VNI : 16/07/2024

Date de paiement : 18/07/2024

				Montant pour porteurs de parts domiciliés			
				en Suisse			à l'étranger
Classe	Affidavit	Coupon n°	Monnaie	Brut par part	Impôt anticipé fédéral moins 35%	Net par part	Net par part
Classe A	Non	18	CHF	0.25	0.0875	0.1625	0.1625
Classe B	Non	19	CHF	0.65	0.2275	0.4225	0.4225
Classe C	Non	19	CHF	0.80	0.28	0.52	0.52
Classe Z	Non	7	CHF	0.55	0.1925	0.3575	0.3575

Chiffres comptables

Aperçu	Devise		01.04.23	01.04.22	01.04.21
			31.03.24	31.03.23	31.03.22
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	consolidée	CHF	1'786'403'238.47	2'072'998'529.30	1'766'077'966.67
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	classe A	CHF	6'072'532.00	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	95.75	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	549'790'477.16	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	96.20	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	420'917'613.69	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	94.38	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	809'622'615.62	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	96.01	90.85	96.20
Total Expense Ratio (TER)	classe Z		0.03%	0.03%	0.03%

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

Compte de fortune (Valeurs vénales)	31.03.24	31.03.23
Avoirs en banque		
à vue	10'706'558.17	127'601'556.07
Valeurs mobilières		
Obligations, obligations convertibles, emprunts à option et autres titres de créance et droits-valeurs	1'761'366'924.99	1'935'381'168.96
Autres actifs	15'646'097.89	10'205'614.37
Fortune totale du fonds à la fin de la période comptable	1'787'719'581.05	2'073'188'339.40
Autres engagements	-1'316'342.58	-189'810.10
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	1'786'403'238.47	2'072'998'529.30

Evolution du nombre de parts de la classe A	Période comptable	01.04.23	01.04.22
		31.03.24	31.03.23
Position au début de la période comptable		172'983.000	170'225
Parts émises		378'635.600	6'849
Parts émises lors du regroupement *)		153'731.645	0
Parts rachetées		-641'931.430	-4'091
Position à la fin de la période comptable		63'418.815	172'983

Evolution du nombre de parts de la classe B	Période comptable	01.04.23	01.04.22
		31.03.24	31.03.23
Position au début de la période comptable		2'017'134.000	1'700'482
Parts émises		2'600'015.401	508'624
Parts émises lors du regroupement *)		1'646'571.283	0
Parts rachetées		-548'366.733	-191'972
Position à la fin de la période comptable		5'715'353.951	2'017'134

Evolution du nombre de parts de la classe C	Période comptable	01.04.23	01.04.22
		31.03.24	31.03.23
Position au début de la période comptable		5'434'588.00	4'379'883
Parts émises		184'428.00	1'516'865
Parts émises lors du regroupement *)		995.32	0
Parts rachetées		-1'159'958.32	-462'160
Position à la fin de la période comptable		4'460'053.00	5'434'588

Evolution du nombre de parts de la classe Z	Période comptable	01.04.23	01.04.22
		31.03.24	31.03.23
Position au début de la période comptable		15'307'917.000	12'209'637
Parts émises		2'229'974.245	3'558'135
Parts rachetées		-9'105'635.021	-459'855
Position à la fin de la période comptable		8'432'256.224	15'307'917

	01.04.23	01.04.22
Variation de la fortune nette du fonds	31.03.24	31.03.23
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	-556'895'162.79	405'754'804.97
Résultat total	115'264'407.05	-80'852'416.69
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	1'786'403'238.47	2'072'998'529.30

*) Regroupement de la fortune du fonds ETHOS - Ethos Bonds CHF avec la fortune du fonds AMC PROFESSIONAL FUND - BCV Swiss Franc Bonds ESG au 31.03.2023.

Compte de résultat	Période comptable	01.04.23	01.04.22
		31.03.24	31.03.23
Revenus			
Revenus des avoirs en banque			
à vue		108'039.05	0.00
Intérêts négatifs		0.00	-86'045.00
Revenus des instruments du marché monétaire		53'107.50	0.00
Revenus des valeurs mobilières			
Obligations, obligations convertibles, emprunts à option et autres titres de créance et droits-valeurs		20'258'286.57	12'640'071.13
Participation des souscripteurs aux revenus nets courus		1'372'176.48	2'268'668.72
Total des revenus		21'791'609.60	14'822'694.85
Charges			
Frais de révision		-3'231.00	0.00
Bonifications réglementaires			
Commission forfaitaire de gestion		-2'955'360.73	-2'032'713.46
Autres charges		-112'607.67	-76'178.80
Participation des porteurs de parts sortants aux revenus nets courus		-877'389.19	-228'505.68
Total des charges		-3'948'588.59	-2'337'397.94
Résultat net		17'843'021.01	12'485'296.91
Gains et pertes de capital réalisés		-62'102'279.87	-29'843'037.53
Résultat réalisé		-44'259'258.86	-17'357'740.62
Variation des gains et pertes de capital non réalisés		159'523'665.91	-63'494'676.07
Résultat total		115'264'407.05	-80'852'416.69

	Période comptable	01.04.23	01.04.22
	31.03.24		31.03.23
Utilisation du résultat de la classe A			
Résultat net		105'187.73	16'830.09
Report de l'année précédente / report de l'année précédente du fonds ETHOS – Ethos Bonds CHF*)		2'124.64	261.78
Résultat disponible pour être réparti		107'312.37	17'091.87
Distribution intermédiaire des revenus		89'698.29	16'953.30
Résultat prévu pour être distribué aux investisseurs		15'854.70	0.00
Report à compte nouveau		1'759.38	138.57
Total		107'312.37	17'091.87

	Période comptable	01.04.23	01.04.22
	31.03.24		31.03.23
Utilisation du résultat de la classe B			
Résultat net		3'957'970.48	759'132.94
Report de l'année précédente / report de l'année précédente du fonds ETHOS – Ethos Bonds CHF*)		40'158.35	60'530.42
Résultat disponible pour être réparti		3'998'128.83	819'663.36
Distribution intermédiaire des revenus		0.00	796'822.40
Résultat prévu pour être distribué aux investisseurs		3'714'980.07	0.00
Report à compte nouveau		283'148.76	22'840.96
Total		3'998'128.83	819'663.36

	Période comptable	01.04.23	01.04.22
	31.03.24		31.03.23
Utilisation du résultat de la classe C			
Résultat net		3'127'924.09	2'272'527.90
Report de l'année précédente / report de l'année précédente du fonds ETHOS – Ethos Bonds CHF*)		497'248.90	123'312.21
Résultat disponible pour être réparti		3'625'172.99	2'395'840.11
Distribution intermédiaire des revenus		0.00	1'898'597.05
Résultat prévu pour être distribué aux investisseurs		3'568'042.40	0.00
Report à compte nouveau		57'130.59	497'243.06
Total		3'625'172.99	2'396'840.11

	Période comptable	01.04.23	01.04.22
	31.03.24		31.03.23
Utilisation du résultat de la classe Z			
Résultat net		10'651'938.71	9'436'805.98
Report de l'année précédente		2'374'113.12	362'856.14
Résultat disponible pour être réparti		13'026'051.83	9'799'662.12
Distribution intermédiaire des revenus		8'318'069.88	7'425'549.00
Résultat prévu pour être distribué aux investisseurs		4'637'740.92	0.00
Report à compte nouveau		70'241.03	2'374'113.12
Total		13'026'051.83	9'799'662.12

*) Regroupement du compte de résultat du fonds ETHOS - Ethos Bonds CHF avec le compte de résultat du fonds AMC PROFESSIONAL FUND - BCV Swiss Franc Bonds ESG au 31.03.2023.

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 %
Valeurs mobilières cotées en bourse						
Obligations					1'749'297'061.95	97.84
CH0419041667	0.07 % First Abu Dhabi Bank 19-27 NT	330'000	CHF	93.95 %	310'035.00	0.02
CH0474977714	0.205 % First Abu Dhabi Bank 19-25	1'490'000	CHF	97.50 %	1'452'750.00	0.08
CH0593893925	0.068 % First Abu Dhabi Bank 21-27 NT	3'750'000	CHF	94.70 %	3'551'250.00	0.19
CH1145096181	0.1475 % First Abu Dhabi Bank 21-26 NT	200'000	CHF	95.90 %	191'800.00	0.01
CH1181713616	1.0625 % First Abu Dhabi Bank 22-26 NT	850'000	CHF	98.65 %	838'525.00	0.05
Emirats arabes unis					6'344'360.00	0.35
CH1160382979	1.285 % Macquarie Group 22-29	2'330'000	CHF	98.40 %	2'292'720.00	0.13
Australie					2'292'720.00	0.13
CH0020632144	2 7/8 % OEBK 05-30	2'380'000	CHF	109.80 %	2'613'240.00	0.15
CH0027752200	2 5/8 % OEBK 06-24	385'000	CHF	100.80 %	388'080.00	0.02
CH0441186480	1/4 % Hypo Vorarlberg Bank 18-25	2'225'000	CHF	98.10 %	2'182'725.00	0.12
CH0525158462	1/8 % Hypo Vorarlberg Bank 20-30 NT	1'990'000	CHF	88.90 %	1'769'110.00	0.10
CH0593893917	1/8 % Hypo Vorarlberg Bank 21-28	2'090'000	CHF	91.95 %	1'921'755.00	0.11
CH1166151972	1/2 % Hypo Vorarlberg Bank 22-27	1'470'000	CHF	97.30 %	1'430'310.00	0.08
CH1216400049	2.87 % BAWAG 22-25	1'410'000	CHF	101.55 %	1'431'855.00	0.08
CH1231094363	1.96 % BAWAG P.S.K. Versicherung 23-31	1'630'000	CHF	102.05 %	1'663'415.00	0.09
CH1233900013	2 3/8 % Hypo Vorarlberg Bank 23-26	1'300'000	CHF	101.25 %	1'316'250.00	0.07
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 23-28	980'000	CHF	101.80 %	997'640.00	0.06
CH1289657095	1 7/8 % Hypo Vorarlberg Bank 23-30	2'790'000	CHF	102.65 %	2'863'935.00	0.16
CH1314941381	2 1/8 % Hypo Vorarlberg Bank 24-27	1'500'000	CHF	100.50 %	1'507'500.00	0.08
Autriche					20'085'815.00	1.12
CH0593893933	0.556 % FONPLATA 21-26	850'000	CHF	95.75 %	813'875.00	0.05
CH1142754287	0.795 % FONPLATA 21-28	1'490'000	CHF	92.10 %	1'372'290.00	0.07
Bolivie					2'186'165.00	0.12
CH0258404455	3/4 % Province of Quebec 14-24 NT	1'430'000	CHF	99.57 %	1'423'851.00	0.08
CH0367206759	1/4 % Province of Ontario 17-29	260'000	CHF	94.85 %	246'610.00	0.01
CH0460054452	1/4 % Province of Manitoba 19-29 NT	2'730'000	CHF	95.20 %	2'598'960.00	0.15
CH1112011510	0.05 % Province of Ontario 21-33	650'000	CHF	89.10 %	579'150.00	0.03
CH1117896477	0.03 % Province of Quebec 21-31 NT	1'170'000	CHF	91.20 %	1'067'040.00	0.06
CH1163572931	0.525 % Province of Saskatchewan 22-32	720'000	CHF	94.40 %	679'680.00	0.04
CH1264823431	2.04 % Province of Quebec 23-33 NT	2'390'000	CHF	106.00 %	2'533'400.00	0.14
Canada					9'128'691.00	0.51
CH0008680370	4 % Confederation Suisse 98-28	10'360'000	CHF	112.67 %	11'672'612.00	0.65
CH0009755197	4 % Confederation Suisse 99-49	1'790'000	CHF	176.01 %	3'150'579.00	0.18

Numéro de valeur classe A :	2 094 395
Numéro de valeur classe B :	2 094 405
Numéro de valeur classe C :	2 094 415
Numéro de valeur classe Z :	21 342 270
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	11

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0015803239	3 1/2 % Confederation Suisse 03-33	1'660'000	CHF	124.62 %	2'068'692.00	0.12
CH0020498645	2 3/4 % Stadt Zuerich 05-25	1'380'000	CHF	101.21 %	1'396'698.00	0.08
CH0020810468	3 % Luzerner KB 05-25	1'075'000	CHF	101.45 %	1'090'587.50	0.06
CH0024484187	2.55 % Stadt Zuerich 06-36	2'000'000	CHF	114.30 %	2'286'000.00	0.13
CH0024524966	2 1/2 % Confederation Suisse 06-36	9'390'000	CHF	121.30 %	11'390'070.00	0.64
CH0025185676	3 % Eurofima 06-26	3'910'000	CHF	103.70 %	4'054'670.00	0.23
CH0031835561	3 1/4 % Confederation Suisse 07-27	5'320'000	CHF	107.59 %	5'723'788.00	0.32
CH0115967397	2 1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 10-32 Series 519	2'150'000	CHF	107.21 %	2'305'015.00	0.13
CH0117076379	1 7/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 10-31 Series 524	6'130'000	CHF	103.93 %	6'370'909.00	0.36
CH0118095667	1 7/8 % Basler KB 10-26	3'260'000	CHF	101.35 %	3'304'010.00	0.18
CH0119015086	2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 10-25 Series 405	2'525'000	CHF	101.08 %	2'552'270.00	0.14
CH0119729793	2 % ZKB 10-34 Series 115	150'000	CHF	105.45 %	158'175.00	0.01
CH0119983077	1 7/8 % Luzerner KB 10-35	150'000	CHF	104.35 %	156'525.00	0.01
CH0120168486	2 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 10-28 Series 533	1'750'000	CHF	103.88 %	1'817'900.00	0.10
CH0124338937	2 5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 11-31 Series 548	6'520'000	CHF	108.66 %	7'084'632.00	0.40
CH0127181029	2 1/4 % Confederation Suisse 11-31	5'730'000	CHF	110.95 %	6'357'435.00	0.35
CH0127181169	1 1/2 % Confederation Suisse 12-42	6'380'000	CHF	113.71 %	7'254'698.00	0.41
CH0127181193	1 1/4 % Confederation Suisse 12-37	3'390'000	CHF	107.00 %	3'627'300.00	0.20
CH0132163434	2 7/8 % KW Linth-Limmern 11-31	570'000	CHF	107.35 %	611'895.00	0.03
CH0138760811	1 5/8 % Stadt Bern 11-24	920'000	CHF	100.15 %	921'380.00	0.05
CH0139458720	1 1/2 % Canton de Geneve 11-24	3'260'000	CHF	100.00 %	3'260'000.00	0.18
CH0141833407	1 3/4 % Basellandschaftliche KB 11-24	3'260'000	CHF	100.14 %	3'264'564.00	0.18
CH0142132031	1 1/2 % Canton de Geneve 12-28	650'000	CHF	101.10 %	657'150.00	0.04
CH0143808340	1 1/4 % Kanton Bern 12-27	1'300'000	CHF	100.30 %	1'303'900.00	0.07
CH0147144361	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 12-28 Series 562	5'070'000	CHF	100.88 %	5'114'616.00	0.29
CH0149549575	1 1/2 % Basler KB 12-27	1'370'000	CHF	100.45 %	1'376'165.00	0.08
CH0180428531	2 7/8 % KW Linth-Limmern 12-42	285'000	CHF	109.00 %	310'650.00	0.02
CH0181215028	1 3/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 12-27 Series 420	3'525'000	CHF	100.33 %	3'536'632.49	0.20
CH0184043542	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 12-27 Series 566	1'960'000	CHF	100.72 %	1'974'112.00	0.11
CH0193395537	1 1/4 % Canton de Neuchatel 12-27	1'370'000	CHF	99.95 %	1'369'315.00	0.08
CH0194273204	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 12-29 Series 574	4'380'000	CHF	100.50 %	4'401'900.00	0.25
CH0194958960	3 % KW Linth-Limmern 12-52	510'000	CHF	107.80 %	549'780.00	0.03
CH0200044789	2 3/8 % Nant de Drance 13-28	220'000	CHF	103.40 %	227'480.00	0.01
CH0200044805	1 7/8 % KW Oberhasli 13-25	590'000	CHF	100.31 %	591'829.00	0.03
CH0204811100	1 5/8 % Swissgrid 13-25	475'000	CHF	100.16 %	475'760.00	0.03
CH0206728823	1 1/2 % Stadt Bern 13-28	1'960'000	CHF	101.35 %	1'986'460.00	0.11
CH0206894740	1 3/8 % Graubuendner KB 13-25	2'730'000	CHF	99.97 %	2'729'181.00	0.15
CH0206992270	1 1/2 % Thurgauer KB 13-27	2'960'000	CHF	100.40 %	2'971'840.00	0.17
CH0208271541	3 % KW Linth-Limmern 13-48	850'000	CHF	111.70 %	949'450.00	0.05
CH0217756656	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 13-25 Series 584	4'730'000	CHF	100.55 %	4'756'015.00	0.27
CH0217825311	1 3/4 % Kanton St. Gallen 13-28	1'960'000	CHF	102.60 %	2'010'960.00	0.11
CH0217825337	2 % Kanton St. Gallen 13-38	750'000	CHF	108.95 %	817'125.00	0.05
CH0221999813	1 5/8 % Stadt Zuerich 13-24	5'320'000	CHF	100.06 %	5'323'192.00	0.30
CH0222261494	1 3/4 % Thurgauer KB 13-24	2'020'000	CHF	100.13 %	2'022'626.00	0.11
CH0224396983	1 1/4 % Confederation Suisse 14-26	8'050'000	CHF	100.74 %	8'109'570.00	0.45
CH0224397007	2 % Confederation Suisse 14-64	200'000	CHF	151.00 %	302'000.00	0.02
CH0224397171	1/2 % Confederation Suisse 15-30	13'525'000	CHF	98.83 %	13'366'757.50	0.75
CH0224397338	1/2 % Confederation Suisse 16-58	5'020'000	CHF	96.20 %	4'829'240.00	0.27

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0224397346	0 % Confederation Suisse 16-29	16'930'000	CHF	96.37 %	16'315'441.00	0.83
CH0224485927	2 % Canton de Vaud 13-33	1'300'000	CHF	107.80 %	1'401'400.00	0.08
CH0224923513	1 3/4 % Schaffhauser KB 13-25	980'000	CHF	100.50 %	984'900.00	0.06
CH0228531437	2 3/8 % KW Linth-Limmern 13-26	1'955'000	CHF	102.00 %	1'994'100.00	0.11
CH0236516834	1 3/4 % Stadt Zuerich 14-29	2'000'000	CHF	102.85 %	2'057'000.00	0.12
CH0239840124	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 14-24 Series 591	1'570'000	CHF	99.93 %	1'568'901.00	0.09
CH0244175201	1 1/4 % Banque Cantonale de Fribourg 14-24	3'330'000	CHF	99.94 %	3'328'002.00	0.19
CH0245691537	1 3/4 % Nant de Drance 14-24	100'000	CHF	100.01 %	100'010.00	0.01
CH0252379802	1 7/8 % Mobimo Holding 14-24	1'410'000	CHF	100.05 %	1'410'705.00	0.08
CH0252703050	1 1/4 % KW Linth-Limmern 14-24	1'600'000	CHF	99.79 %	1'596'640.00	0.09
CH0252903767	1 3/8 % Kanton Basel-Stadt 14-34	1'080'000	CHF	102.20 %	1'103'760.00	0.06
CH0254212233	1 % Kanton Zuerich 14-27	680'000	CHF	99.55 %	676'940.00	0.04
CH0255678333	1 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 14-26 Series 598	2'840'000	CHF	99.40 %	2'822'960.00	0.16
CH0255678341	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 14-32 Series 599	1'980'000	CHF	100.30 %	1'985'939.99	0.11
CH0256434603	3/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 14-24 Series 456	500'000	CHF	99.64 %	498'200.00	0.03
CH0257042173	2 % Swiss Prime Site Finance 14-24	650'000	CHF	100.32 %	652'080.00	0.04
CH0261399064	1 1/8 % Baloise-Holding 14-24	460'000	CHF	99.71 %	458'666.00	0.03
CH0262883199	1 3/8 % Grande Dixence 15-25	1'350'000	CHF	99.70 %	1'345'950.00	0.08
CH0263432988	1 % Centr. LdG Bques Cant. CH 14-28 Series 459	3'000'000	CHF	98.89 %	2'966'700.00	0.17
CH0264227015	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 14-25 Series 603	3'650'000	CHF	99.29 %	3'624'085.00	0.20
CH0265801198	0.55 % Banque Cantonale de Fribourg 15-25	1'285'000	CHF	99.24 %	1'275'234.00	0.07
CH0266307377	5/8 % Kanton Bern 15-32	200'000	CHF	95.60 %	191'200.00	0.01
CH0267222310	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-30 Series 604	3'070'000	CHF	94.97 %	2'915'579.00	0.16
CH0267855986	1/8 % Kanton Baselland 15-26	1'170'000	CHF	98.05 %	1'147'185.00	0.06
CH0268786982	5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-30 Series 460	3'120'000	CHF	96.30 %	3'004'560.00	0.17
CH0268988182	1 % Swisscom 15-35 Tranche 2	1'340'000	CHF	94.15 %	1'261'610.00	0.07
CH0269697931	3/8 % Schaffhauser KB 15-27	1'960'000	CHF	97.15 %	1'904'140.00	0.11
CH0269796212	1/2 % Thurgauer KB 15-29	650'000	CHF	96.10 %	624'650.00	0.03
CH0270190991	5/8 % Novartis 15-29	1'775'000	CHF	96.55 %	1'713'762.50	0.10
CH0270191007	1.05 % Novartis 15-35	580'000	CHF	96.40 %	559'120.00	0.03
CH0271288547	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-28 Series 605	2'670'000	CHF	96.96 %	2'588'832.00	0.14
CH0272154177	1 % Kanton Baselland 15-40	120'000	CHF	96.00 %	115'200.00	0.01
CH0273347838	1 3/8 % Allreal Holding 15-25	1'355'000	CHF	99.58 %	1'349'309.00	0.08
CH0273485398	5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-29 Series 462	2'095'000	CHF	96.72 %	2'026'284.00	0.11
CH0274253514	0.60 % Banque Cantonale de Fribourg 15-27	4'340'000	CHF	97.55 %	4'233'670.00	0.24
CH0274314787	3/4 % Basellandschaftliche KB 15-28	1'550'000	CHF	97.65 %	1'513'575.00	0.08
CH0275352125	3/8 % Thurgauer KB 15-25	1'110'000	CHF	98.99 %	1'098'789.00	0.06
CH0276581094	0.55 % Spitalverband Limmattal 15-25	720'000	CHF	98.43 %	708'696.00	0.04
CH0278667115	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-30 Series 464	3'420'000	CHF	95.52 %	3'266'784.00	0.18
CH0279720343	1/4 % Basellandschaftliche KB 15-25	1'110'000	CHF	98.68 %	1'095'348.00	0.06
CH0280569135	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-34 Series 610	1'630'000	CHF	93.34 %	1'521'442.00	0.09
CH0282019006	1 1/4 % Services Industriels de Geneve 15-25	260'000	CHF	99.63 %	259'038.00	0.01
CH0284087589	1/2 % St.Galler KB 15-25	2'740'000	CHF	98.86 %	2'708'764.00	0.15
CH0285849367	5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-27 Series 466	7'630'000	CHF	97.99 %	7'476'637.00	0.42
CH0286138877	3/4 % Berner KB 15-25	2'025'000	CHF	99.02 %	2'005'155.00	0.11
CH0288286385	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-25 Series 467	4'870'000	CHF	98.95 %	4'818'865.00	0.27
CH0290876512	5/8 % Lugano 15-25	1'440'000	CHF	98.96 %	1'425'024.00	0.08
CH0291625231	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-26 Series 616	6'470'000	CHF	98.38 %	6'365'186.00	0.36

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0293026222	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-31 Series 617	2'220'000	CHF	95.47 %	2'119'434.00	0.12
CH0297132364	1 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-36 Series 619	7'305'000	CHF	96.07 %	7'017'913.50	0.39
CH0297343565	1/2 % Kanton Solothurn 15-30 Tranche 2	650'000	CHF	95.70 %	622'050.00	0.03
CH0299297280	3/4 % ZKB 15-30 Series 135	1'890'000	CHF	96.05 %	1'815'345.00	0.10
CH0300874283	5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-30 Series 471	4'040'000	CHF	95.77 %	3'869'108.00	0.22
CH0302424392	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-29 Series 621	6'070'000	CHF	96.10 %	5'833'270.00	0.33
CH0304755157	3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-34 Series 623	8'000'000	CHF	93.87 %	7'509'600.00	0.42
CH0305954569	1/4 % Kanton Aargau 15-29 Tr. 2	1'430'000	CHF	95.15 %	1'360'645.00	0.08
CH0306173730	1/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-26 Series 473	2'970'000	CHF	97.84 %	2'905'848.00	0.16
CH0306173748	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-30 Series 474	2'930'000	CHF	95.15 %	2'787'895.00	0.16
CH0306626224	2 % Nant de Drance 16-26	1'105'000	CHF	100.85 %	1'114'392.50	0.06
CH0307256450	0.60 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-35 Series 476	6'870'000	CHF	91.70 %	6'299'790.00	0.35
CH0310175564	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-26 Series 625	4'730'000	CHF	97.66 %	4'619'318.00	0.26
CH0310451858	1 1/4 % UBS Group Funding (Switzerland) 16-26 Tranche 2	400'000	CHF	99.20 %	396'800.00	0.02
CH0310646523	1/2 % Banque Cantonale de Fribourg 16-28	2'780'000	CHF	96.35 %	2'678'530.00	0.15
CH0312512640	1/4 % Graubundner KB 16-28	650'000	CHF	96.00 %	624'000.00	0.03
CH0319415938	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-32 Series 628	4'090'000	CHF	93.05 %	3'805'745.00	0.21
CH0319416126	0.04 % Stadt Bern 16-27	1'760'000	CHF	96.75 %	1'702'800.00	0.10
CH0319932767	0.40 % BCV 16-31	3'405'000	CHF	92.00 %	3'132'600.00	0.18
CH0320712596	0.30 % Raiffeisen Suisse 16-25 Tranche 1	490'000	CHF	98.78 %	484'022.00	0.03
CH0326213912	1/4 % Kinderspital Zuerich - Eleonorenstiftung 16-28	1'720'000	CHF	94.95 %	1'633'140.00	0.09
CH0326213920	0.60 % Canton de Geneve 16-46	1'370'000	CHF	85.15 %	1'166'555.00	0.07
CH0328298069	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-39 Series 632	1'100'000	CHF	85.95 %	945'450.00	0.05
CH0328599235	0.06 % Aargauische KB 16-25	200'000	CHF	98.31 %	196'620.00	0.01
CH0330143188	0.02 % ZKB 16-27 Series 139	3'070'000	CHF	95.60 %	2'934'920.00	0.16
CH0330938835	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-38 Series 633	1'995'000	CHF	85.23 %	1'700'338.50	0.10
CH0331455334	0 % Kanton Basel-Stadt 16-26	1'370'000	CHF	97.35 %	1'333'695.00	0.07
CH0331455342	0 % Kanton Basel-Stadt 16-29	550'000	CHF	94.10 %	517'550.00	0.03
CH0336352742	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-31 Series 635	1'960'000	CHF	91.76 %	1'798'496.00	0.10
CH0336352767	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-46 Series 637	800'000	CHF	80.41 %	643'280.00	0.04
CH0336587719	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-27 Series 483	11'730'000	CHF	96.52 %	11'321'796.00	0.63
CH0337645581	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-26 Series 485	2'520'000	CHF	96.90 %	2'441'880.00	0.14
CH0338330415	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-32 Series 639	2'950'000	CHF	90.26 %	2'662'670.00	0.15
CH0338330472	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-36 Series 641	5'585'000	CHF	87.15 %	4'867'327.50	0.27
CH0340953428	1/2 % BCV 16-28	1'915'000	CHF	96.10 %	1'840'315.00	0.10
CH0342587638	0.05 % ZKB 16-26 Series 140	2'160'000	CHF	96.60 %	2'086'560.00	0.12
CH0344583809	1/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-24 Series 486	4'570'000	CHF	99.12 %	4'529'784.00	0.25
CH0344583817	3/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-28 Series 487	1'300'000	CHF	96.10 %	1'249'300.00	0.07
CH0344958472	1/2 % Confederation Suisse 17-55	3'330'000	CHF	95.00 %	3'163'500.00	0.18
CH0344958498	1/2 % Confederation Suisse 17-45	8'675'000	CHF	95.69 %	8'301'107.50	0.46
CH0344958688	1/2 % Confederation Suisse 18-32	14'405'000	CHF	98.56 %	14'197'568.00	0.79
CH0347556927	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-37 Series 645	5'110'000	CHF	91.50 %	4'675'650.00	0.26
CH0352419615	5/8 % St.Galler KB 17-32	820'000	CHF	94.15 %	772'030.00	0.04
CH0352595851	0.20 % Banque Cantonale du Valais 17-26	150'000	CHF	97.85 %	146'775.00	0.01
CH0352595885	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-27 Series 489	5'400'000	CHF	97.03 %	5'239'620.00	0.29
CH0352595893	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 17-32 Series 490	5'860'000	CHF	93.82 %	5'497'852.00	0.31
CH0353105197	3/8 % Thurgauer KB 17-28	1'430'000	CHF	96.30 %	1'377'090.00	0.08
CH0353428037	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-29 Series 646	4'750'000	CHF	95.66 %	4'543'850.00	0.25

Numéro de valeur classe A :	2 094 395
Numéro de valeur classe B :	2 094 405
Numéro de valeur classe C :	2 094 415
Numéro de valeur classe Z :	21 342 270
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	14

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0353574319	0.30 % Basler KB 17-27	690'000	CHF	96.75 %	667'575.00	0.04
CH0354836113	3/4 % Mobimo Holding 17-26	460'000	CHF	98.20 %	451'720.00	0.03
CH0357676177	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 17-29 Series 493	4'170'000	CHF	95.97 %	4'001'949.00	0.22
CH0358654975	0.10 % Roche Kapitalmarkt 17-24 Tranche 2	1'830'000	CHF	99.35 %	1'818'105.00	0.10
CH0359915409	0.45 % Roche Kapitalmarkt 17-29 Tranche 3	820'000	CHF	96.20 %	788'840.00	0.04
CH0360677295	0.825 % Swiss Prime Site Finance 17-26	1'700'000	CHF	98.40 %	1'672'800.00	0.09
CH0361532820	1/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 17-27 Series 494	4'580'000	CHF	96.91 %	4'438'478.00	0.25
CH0361532895	0.15 % Partners Group Holding 17-24	3'360'000	CHF	99.73 %	3'350'928.00	0.19
CH0361532911	1/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 17-26 Series 495	3'910'000	CHF	97.88 %	3'827'108.00	0.21
CH0361532952	1 1/8 % Grande Dixence 17-24	3'120'000	CHF	99.83 %	3'114'696.00	0.17
CH0361533232	7/8 % Ville de Lausanne 17-42	450'000	CHF	90.40 %	406'800.00	0.02
CH0367206718	3/8 % Cembra Money Bank 17-25	2'740'000	CHF	98.59 %	2'701'366.00	0.15
CH0370943547	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-26 Series 651	5'400'000	CHF	97.47 %	5'263'380.00	0.29
CH0373476040	1/2 % Banque Cler 17-25	390'000	CHF	98.40 %	383'760.00	0.02
CH0373476339	0.30 % ZKB 18-28 Series 142	1'650'000	CHF	96.25 %	1'588'125.00	0.09
CH0373476412	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 18-28 Series 499	6'300'000	CHF	96.97 %	6'109'110.00	0.34
CH0373476420	0.65 % Centr. LdG Bques Cant. CH 18-33 Series 500	4'170'000	CHF	94.17 %	3'926'889.00	0.22
CH0373476776	1/8 % Graubundner KB 18-24	1'830'000	CHF	99.77 %	1'825'791.00	0.10
CH0373476784	1/2 % Schaffhauser KB 18-28	720'000	CHF	96.45 %	694'440.00	0.04
CH0373476800	3/4 % Coop-Gruppe Genossenschaft 18-25	1'415'000	CHF	99.12 %	1'402'548.00	0.08
CH0379354225	1/4 % Aargauische KB 17-26	820'000	CHF	97.30 %	797'860.00	0.04
CH0384125073	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-30 Series 655	870'000	CHF	95.80 %	833'460.00	0.05
CH0384125081	3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-38 Series 656	1'000'000	CHF	91.75 %	917'500.00	0.05
CH0391648018	1.55 % Nant de Drance 18-25	1'990'000	CHF	100.00 %	1'990'000.00	0.11
CH0397450724	1/4 % Basellandschaftliche KB 18-27	3'850'000	CHF	96.95 %	3'732'575.00	0.21
CH0398633229	1/2 % Zurich Compagnie d'Assurances 18-24 NT	2'830'000	CHF	99.32 %	2'810'756.00	0.16
CH0398633252	1 % Swiss Prime Site Finance 18-24	250'000	CHF	99.85 %	249'625.00	0.01
CH0398633575	5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 18-29 Series 507	1'040'000	CHF	96.97 %	1'008'488.00	0.06
CH0398633799	0.15 % ZKB 19-27 Series 144	2'510'000	CHF	96.70 %	2'427'170.00	0.14
CH0398633922	3/8 % Graubundner KB 19-32	2'150'000	CHF	91.90 %	1'975'850.00	0.11
CH0399611307	0.35 % Luzerner KB 18-27	595'000	CHF	97.30 %	578'935.00	0.03
CH0405985836	0.70 % Thurgauer KB 18-30	2'770'000	CHF	96.00 %	2'659'200.00	0.15
CH0405986057	1/4 % Aargauische KB 18-25	1'930'000	CHF	98.83 %	1'907'419.00	0.11
CH0406415262	0.15 % Stadt Winterthur 18-25	500'000	CHF	98.78 %	493'900.00	0.03
CH0411478099	0.40 % BEKB 18-27	1'170'000	CHF	96.85 %	1'133'145.00	0.06
CH0413618353	0.70 % Kantonsspital Baden 18-28	1'400'000	CHF	97.10 %	1'359'400.00	0.08
CH0413618361	1.10 % Kantonsspital Baden 18-33	260'000	CHF	95.55 %	248'430.00	0.01
CH0414522273	0.10 % Luzerner KB 18-24	320'000	CHF	99.86 %	319'552.00	0.02
CH0419040800	0.41 % Luzerner KB 19-29	1'860'000	CHF	95.55 %	1'777'230.00	0.10
CH0419040842	0.55 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-31 Series 508	5'650'000	CHF	95.10 %	5'373'150.00	0.30
CH0419040891	1/2 % Kanton Basel-Stadt 19-34	1'300'000	CHF	93.50 %	1'215'500.00	0.07
CH0419040925	1.05 % Ville de Lausanne 19-44	1'340'000	CHF	92.30 %	1'236'820.00	0.07
CH0419040941	0.30 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-29 Series 509	9'250'000	CHF	95.35 %	8'819'875.00	0.49
CH0419040958	0.70 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-39 Series 510	965'000	CHF	90.58 %	874'097.00	0.05
CH0419040982	1/2 % Swisscom 19-29	720'000	CHF	95.40 %	686'880.00	0.04
CH0419040990	1 1/4 % Swiss Prime Site Finance 19-27	520'000	CHF	98.95 %	514'540.00	0.03
CH0419041006	0.15 % Basler KB 19-27	3'780'000	CHF	96.50 %	3'647'700.00	0.20
CH0419041071	5/8 % Ville de Bienne 19-27	650'000	CHF	97.75 %	635'375.00	0.04

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0419041147	3/8 % Basellandschaftliche KB 19-30	2'000'000	CHF	94.10 %	1'882'000.00	0.11
CH0419041188	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-34 Series 513	4'680'000	CHF	91.69 %	4'291'092.00	0.24
CH0419041238	1/8 % ZKB 19-29 Series 145	1'300'000	CHF	93.80 %	1'219'400.00	0.07
CH0419041337	0 % Valiant Bank 19-29	2'725'000	CHF	91.60 %	2'496'100.00	0.14
CH0419041352	0.285 % Cembra Money Bank 19-27	330'000	CHF	96.00 %	316'800.00	0.02
CH0419041378	5/8 % Aarekraftwerk Klingnau 19-29	420'000	CHF	96.10 %	403'620.00	0.02
CH0419041428	0 % Kantonsspital Winterthur 19-31	330'000	CHF	88.90 %	293'370.00	0.02
CH0419041436	0 % Aargauische KB 19-29	1'300'000	CHF	92.70 %	1'205'100.00	0.07
CH0419041469	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-37 Series 514	2'120'000	CHF	82.49 %	1'748'788.00	0.10
CH0419041485	0.10 % Berner KB 19-39	1'320'000	CHF	77.30 %	1'020'360.00	0.06
CH0419041584	0.10 % St.Galler KB 19-41	3'080'000	CHF	80.25 %	2'471'700.00	0.14
CH0419041675	0 % Banque Valiant 19-25	4'020'000	CHF	97.60 %	3'923'520.00	0.22
CH0419042509	3/4 % Nestle 18-28	1'730'000	CHF	97.90 %	1'693'670.00	0.09
CH0423233524	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-29 Series 660	2'730'000	CHF	96.41 %	2'631'993.00	0.15
CH0428194242	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-28 Series 661	4'680'000	CHF	96.30 %	4'506'840.00	0.25
CH0433761316	3/4 % Roche Kapitalmarkt 18-30	390'000	CHF	96.65 %	376'935.00	0.02
CH0434678394	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-28 Series 663	2'090'000	CHF	97.18 %	2'031'062.00	0.11
CH0437180935	3/4 % Swisscom 18-28	650'000	CHF	97.05 %	630'825.00	0.04
CH0438965581	1 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-47 Series 665	2'405'000	CHF	95.03 %	2'285'471.50	0.13
CH0440081393	0 % Confederation Suisse 19-34	15'560'000	CHF	93.16 %	14'495'696.00	0.81
CH0440081401	0 % Confederation Suisse 19-39	7'870'000	CHF	90.28 %	7'105'036.00	0.40
CH0440081567	1 1/2 % Confederation Suisse 22-38	9'130'000	CHF	111.00 %	10'134'300.00	0.57
CH0443027047	0.15 % Aargauische KB 18-24	300'000	CHF	99.18 %	297'540.00	0.02
CH0443057515	1/2 % Thurgauer KB 18-26	200'000	CHF	97.70 %	195'400.00	0.01
CH0459810534	1/8 % Aargauische KB 19-26	4'080'000	CHF	97.75 %	3'988'200.00	0.22
CH0460054403	0.45 % Banca dello Stato del Cantone Ticino 19-29	835'000	CHF	94.90 %	792'415.00	0.04
CH0460054429	7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-43 Series 668	2'770'000	CHF	91.13 %	2'524'301.00	0.14
CH0461238963	0.10 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-31 Series 515	8'000'000	CHF	91.09 %	7'287'200.00	0.41
CH0461239029	1/8 % Banque Valiant 19-34	2'200'000	CHF	85.45 %	1'879'900.00	0.11
CH0461239045	0.05 % ZKB 20-31 Series 146	3'960'000	CHF	91.25 %	3'613'500.00	0.20
CH0461239086	0.05 % Basellandschaftliche KB 20-31	2'350'000	CHF	91.20 %	2'143'200.00	0.12
CH0471297926	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-30 Series 671	5'900'000	CHF	94.00 %	5'546'000.00	0.31
CH0474977698	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-29 Series 672	3'975'000	CHF	94.35 %	3'750'412.50	0.21
CH0474977730	0.80 % Grande Dixence 19-26	1'960'000	CHF	98.20 %	1'924'720.00	0.11
CH0482172399	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-41 Series 674	2'370'000	CHF	86.16 %	2'041'992.00	0.11
CH0483180938	0.05 % Banca dello Stato del Cantone Ticino 19-29	3'105'000	CHF	92.35 %	2'867'467.50	0.16
CH0484360380	1/4 % Kanton Zuerich 19-39	3'650'000	CHF	86.55 %	3'159'075.00	0.18
CH0485252800	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-27 Series 675	3'910'000	CHF	96.05 %	3'755'555.00	0.21
CH0485252818	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-34 Series 676	7'490'000	CHF	89.66 %	6'715'534.00	0.38
CH0485252826	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-44 Series 677	1'850'000	CHF	84.70 %	1'566'950.00	0.09
CH0485252875	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-49 Series 678	3'020'000	CHF	70.14 %	2'118'228.00	0.12
CH0485260902	0.10 % Banque Cantonale de Fribourg 19-44	2'100'000	CHF	74.65 %	1'567'650.00	0.09
CH0494734335	0 % Swisscom 19-44	330'000	CHF	71.20 %	234'960.00	0.01
CH0494734392	0 % Canton de Geneve 19-59	795'000	CHF	64.15 %	509'992.50	0.03
CH0496692978	0 % Baloise-Holding 19-26	390'000	CHF	96.50 %	376'350.00	0.02
CH0505011913	0 % Canton de Geneve 19-28	880'000	CHF	95.10 %	836'880.00	0.05
CH0506071114	0 % Banque Cantonale de Fribourg 20-30	880'000	CHF	91.90 %	808'720.00	0.05
CH0506071130	0 % Luzerner KB 20-28	280'000	CHF	94.30 %	264'040.00	0.01

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0506071163	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-31 Series 517	7'000'000	CHF	91.32 %	6'392'400.00	0.36
CH0506071171	0.02 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-40 Series 518	2'610'000	CHF	80.29 %	2'095'569.00	0.12
CH0506071221	0 % ZKB 20-30 Series 147	970'000	CHF	92.15 %	893'855.00	0.05
CH0506071270	0.14 % Banque Cantonale de Fribourg 20-30	2'780'000	CHF	92.25 %	2'564'550.00	0.14
CH0506071288	0.01 % Aargauische KB 20-28	1'995'000	CHF	94.45 %	1'884'277.50	0.11
CH0506071296	0 % Kanton Luzern 20-30	1'960'000	CHF	93.10 %	1'824'760.00	0.10
CH0506071338	1/8 % Luzerner KB 20-32	1'140'000	CHF	89.70 %	1'022'580.00	0.06
CH0506071395	1/4 % Basler KB 21-36	250'000	CHF	86.90 %	217'250.00	0.01
CH0508785752	1/4 % Stadt Zuerich 19-39	3'535'000	CHF	86.15 %	3'045'402.50	0.17
CH0511762061	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-27 Series 682	4'580'000	CHF	96.29 %	4'410'082.00	0.25
CH0515152483	0.405 % Raiffeisen Suisse 21-29 Series 3	1'100'000	CHF	93.00 %	1'023'000.00	0.06
CH0520663672	0.20 % Flughafen Zuerich 20-35	990'000	CHF	86.60 %	857'340.00	0.05
CH0521617297	0 % Banque Cantonale du Valais 20-29	400'000	CHF	93.45 %	373'800.00	0.02
CH0522158895	0 % Kanton Luzern 21-31	1'110'000	CHF	91.80 %	1'018'980.00	0.06
CH0522158945	0.10 % Aargauische KB 21-30	980'000	CHF	91.75 %	899'150.00	0.05
CH0522158960	0.3126 % Banque Cantonale de Fribourg 22-32	1'930'000	CHF	91.50 %	1'765'950.00	0.10
CH0522158978	0.35 % St.Galler KB 22-31	1'300'000	CHF	92.40 %	1'201'200.00	0.07
CH0522158994	0.01 % Basellandschaftliche KB 22-26	200'000	CHF	96.90 %	193'800.00	0.01
CH0522159000	1 5/8 % Kanton Luzern 22-42	780'000	CHF	102.10 %	796'380.00	0.04
CH0522159034	1.70 % Basellandschaftliche KB 22-42	1'300'000	CHF	103.00 %	1'339'000.00	0.07
CH0522159042	1.60 % Basellandschaftliche KB 22-32	2'150'000	CHF	101.40 %	2'180'100.00	0.12
CH0522159091	1.40 % St.Galler KB 22-30	3'040'000	CHF	100.05 %	3'041'520.00	0.17
CH0525158371	0.10 % Zurich Compagnie d'Assurances 20-32 NT	2'395'000	CHF	88.60 %	2'121'970.00	0.12
CH0525158397	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-28 Series 683	2'930'000	CHF	95.20 %	2'789'360.00	0.16
CH0525158413	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-45 Series 684	1'765'000	CHF	74.30 %	1'311'395.00	0.07
CH0528881169	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-30 Series 685	9'000'000	CHF	92.66 %	8'339'400.00	0.47
CH0528881201	1/4 % Canton de Geneve 20-28	830'000	CHF	96.40 %	800'120.00	0.04
CH0536892588	0.95 % SGS 20-26	1'675'000	CHF	98.60 %	1'651'550.00	0.09
CH0536892612	0.70 % Flughafen Zuerich 20-24	2'330'000	CHF	99.87 %	2'326'971.00	0.13
CH0536892737	0 % Kanton Zuerich 20-28	650'000	CHF	95.55 %	621'075.00	0.03
CH0536892745	0.10 % Kanton Zuerich 20-45	2'355'000	CHF	78.10 %	1'839'255.00	0.10
CH0536892901	0.20 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-35 Series 523	9'270'000	CHF	87.59 %	8'119'593.00	0.45
CH0536893339	0.15 % Swissgrid 20-34	2'650'000	CHF	87.25 %	2'312'125.00	0.13
CH0536893412	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-30 Series 526	9'440'000	CHF	92.21 %	8'704'624.00	0.49
CH0537261924	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-27 Series 686	1'960'000	CHF	96.27 %	1'886'892.00	0.11
CH0537261932	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-40 Series 687	650'000	CHF	86.99 %	565'435.00	0.03
CH0539032950	7/8 % Adecco Group 20-25 NT	650'000	CHF	99.05 %	643'825.00	0.04
CH0543827205	1 1/4 % Nant de Drance 20-27	2'985'000	CHF	99.10 %	2'958'135.00	0.17
CH0545754688	1/8 % Basler KB 20-32	1'700'000	CHF	89.75 %	1'525'750.00	0.09
CH0547243235	0.05 % Canton de Geneve 20-29	2'410'000	CHF	94.00 %	2'265'400.00	0.13
CH0550413386	0.60 % Ville de Lausanne 20-50	2'020'000	CHF	80.80 %	1'632'160.00	0.09
CH0553331809	1.05 % Ferring Holding 20-25	2'050'000	CHF	99.12 %	2'031'960.00	0.11
CH0553331817	1/4 % Baloise-Holding 20-26	780'000	CHF	96.85 %	755'430.00	0.04
CH0553331858	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-30 Series 690	5'670'000	CHF	92.95 %	5'270'265.00	0.29
CH0553331866	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-41 Series 691	3'680'000	CHF	82.90 %	3'050'720.00	0.17
CH0557778310	1/4 % Confederation Suisse 21-35	5'305'000	CHF	95.30 %	5'055'665.00	0.28
CH0561923845	0.80 % Sulzer 20-25	1'285'000	CHF	98.70 %	1'268'295.00	0.07
CH0561923878	0 % Stadt Zuerich 20-60	1'625'000	CHF	65.05 %	1'057'062.50	0.06

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0564642046	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-40 Series 692	3'330'000	CHF	81.31 %	2'707'623.00	0.15
CH0564642053	0.07 % Credit Agricole next bank (Suisse) 20-29	1'580'000	CHF	92.25 %	1'457'550.00	0.08
CH0564642079	0.01 % Lindt & Spruengli 20-28	1'680'000	CHF	94.15 %	1'581'720.00	0.09
CH0565650832	1/4 % Basellandschaftliche KB 20-32	2'030'000	CHF	90.60 %	1'839'180.00	0.10
CH0568056219	0.14 % Stadt St.Gallen 20-44	330'000	CHF	77.95 %	257'235.00	0.01
CH0569237669	0.20 % Canton de Geneve 20-35	2'160'000	CHF	88.10 %	1'902'960.00	0.11
CH0570576113	7/8 % Nant de Drance 20-29	2'485'000	CHF	96.40 %	2'395'540.00	0.13
CH0570576121	0.05 % ZKB 20-32 Series 148	1'440'000	CHF	88.95 %	1'280'880.00	0.07
CH0570576279	1/8 % Swissgrid 20-36	250'000	CHF	83.60 %	209'000.00	0.01
CH0572899257	1/2 % Raiffeisen Suisse 20-28	3'100'000	CHF	94.60 %	2'932'600.00	0.16
CH0575017071	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-29 Series 695	6'820'000	CHF	93.11 %	6'350'102.00	0.36
CH0575017089	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-32 Series 696	6'110'000	CHF	90.30 %	5'517'330.00	0.31
CH0581947816	3/8 % Swiss Prime Site Finance 21-28	705'000	CHF	95.35 %	672'217.50	0.04
CH0589030946	0 % ZKB 21-33 Series 149	3'230'000	CHF	88.20 %	2'848'860.00	0.16
CH0589031019	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-29 Series 529	5'930'000	CHF	94.09 %	5'579'537.00	0.31
CH0589031035	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-36 Series 531	2'480'000	CHF	85.05 %	2'109'240.00	0.12
CH0591084253	0.57 % Raiffeisen Suisse 21-31 Series 2	2'300'000	CHF	92.10 %	2'118'300.00	0.12
CH0591979619	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-41 Series 697	245'000	CHF	78.52 %	192'374.00	0.01
CH0598928718	3/8 % UBS Group 21-29 NT	1'600'000	CHF	92.85 %	1'485'600.00	0.08
CH1100259758	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-31 Series 700	5'020'000	CHF	92.16 %	4'626'432.00	0.26
CH1101096464	0.10 % ZKB 21-31 Series 150	1'500'000	CHF	91.45 %	1'371'750.00	0.08
CH1101096522	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-28 Series 534	4'240'000	CHF	95.19 %	4'036'056.00	0.23
CH1101096621	0 % Kanton Zuerich 21-33	1'210'000	CHF	89.40 %	1'081'740.00	0.06
CH1105672690	0.30 % Grande Dixence 21-28	260'000	CHF	94.35 %	245'310.00	0.01
CH1111392853	0 % Kanton Bern 21-33	1'300'000	CHF	89.45 %	1'162'850.00	0.07
CH1111392861	0.10 % Banque Cantonale du Valais 21-31	1'000'000	CHF	91.00 %	910'000.00	0.05
CH1112455766	1/4 % Swisscom 21-33	1'110'000	CHF	88.75 %	985'125.00	0.06
CH1118223408	0.15 % Stiftung Kantonsspital Graubuenden 21-30	1'700'000	CHF	91.95 %	1'563'150.00	0.09
CH1118223481	0.05 % Kantonsspital St. Gallen 21-31	1'300'000	CHF	89.35 %	1'161'550.00	0.06
CH1118223499	0.30 % Kantonsspital St. Gallen 21-36	1'140'000	CHF	84.25 %	960'450.00	0.05
CH1122290187	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-27 Series 704	2'670'000	CHF	95.54 %	2'550'918.00	0.14
CH1129053794	1/8 % BCV 21-33	720'000	CHF	87.75 %	631'800.00	0.04
CH1129053828	0.20 % Swissgrid 21-40	260'000	CHF	78.35 %	203'710.00	0.01
CH1130818839	1/8 % Baloise-Holding 21-30	520'000	CHF	91.20 %	474'240.00	0.03
CH1131931243	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-31 Series 538	6'400'000	CHF	90.85 %	5'814'400.00	0.33
CH1131931276	0 % Kantonsspital Winterthur 21-25	1'110'000	CHF	97.80 %	1'085'580.00	0.06
CH1131931292	0 % Swissgrid 21-26	985'000	CHF	96.90 %	954'465.00	0.05
CH1131931318	0.20 % WWZ 21-33	200'000	CHF	88.25 %	176'500.00	0.01
CH1131931409	0.30 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-36 Series 540	3'550'000	CHF	87.17 %	3'094'535.00	0.17
CH1132966339	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-36 Series 707	4'930'000	CHF	87.64 %	4'320'652.00	0.24
CH1132966354	1/8 % Inselspital-Stiftung 21-29	2'870'000	CHF	92.65 %	2'659'055.00	0.15
CH1137122755	0.05 % Tecan Group 21-25	2'410'000	CHF	97.85 %	2'358'185.00	0.13
CH1141700430	1/4 % Stadt Zuerich 21-51	1'780'000	CHF	75.90 %	1'351'020.00	0.08
CH1141700463	0.20 % Kanton Bern 21-36	2'090'000	CHF	87.40 %	1'826'660.00	0.10
CH1145096165	0.435 % UBS Group 21-28	1'800'000	CHF	94.60 %	1'702'800.00	0.10
CH1148266161	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-28 Series 709	3'610'000	CHF	94.88 %	3'425'168.00	0.19
CH1148728046	0.10 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-31 Series 541	6'650'000	CHF	91.83 %	6'106'695.00	0.34
CH1148728111	0.20 % ZKB 22-30	650'000	CHF	92.90 %	603'850.00	0.03

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1148728178	3/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-32 Series 542	5'330'000	CHF	92.16 %	4'912'128.00	0.27
CH1148728269	0.65 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-31 Series 545	2'480'000	CHF	95.25 %	2'362'200.00	0.13
CH1148728277	3/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-37 Series 546	1'300'000	CHF	92.16 %	1'198'080.00	0.07
CH1151526154	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-31 Series 710	3'390'000	CHF	91.22 %	3'092'358.00	0.17
CH1160382896	0.22 % Credit Agricole next bank (Suisse) 22-28	3'460'000	CHF	94.55 %	3'271'430.00	0.18
CH1166151907	3/4 % Roche Kapitalmarkt 22-31	3'050'000	CHF	96.35 %	2'938'675.00	0.16
CH1166151949	3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-35 Series 715	6'120'000	CHF	93.33 %	5'711'796.00	0.32
CH1170565621	1/4 % ZKB 22-28 Series 154	1'860'000	CHF	95.80 %	1'781'880.00	0.10
CH1170565662	0.90 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-33 Series 548	2'610'000	CHF	96.13 %	2'508'993.00	0.14
CH1170565720	1.30 % Banque Cantonale de Neuchatel 22-32	330'000	CHF	98.40 %	324'720.00	0.02
CH1170565803	1.40 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-32 Series 551	8'230'000	CHF	100.53 %	8'273'619.00	0.46
CH1170565811	1.45 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-42 Series 552	2'610'000	CHF	100.65 %	2'626'964.99	0.15
CH1174335781	1 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-30 Series 716	5'540'000	CHF	98.23 %	5'441'942.00	0.30
CH1177791840	3/4 % Stadt Zuerich 22-31	1'300'000	CHF	97.15 %	1'262'950.00	0.07
CH1179534966	1.70 % Grande Dixence 22-29	1'570'000	CHF	100.15 %	1'572'355.00	0.09
CH1179535013	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-32 Series 718	6'370'000	CHF	100.38 %	6'394'206.00	0.36
CH1179535021	1 5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-38 Series 719	4'120'000	CHF	103.02 %	4'244'424.00	0.24
CH1182086848	1.65 % Kantonsspital Aarau 22-37	1'060'000	CHF	98.20 %	1'040'920.00	0.06
CH1189217719	1.30 % % Graubuendner KB 22-30	2'995'000	CHF	99.65 %	2'984'517.50	0.17
CH1189217768	1.70 % Kantonsspital Baselland 22-32	2'240'000	CHF	100.50 %	2'251'200.00	0.13
CH1189217784	1.10 % Swissgrid 22-27	1'715'000	CHF	99.05 %	1'698'707.50	0.10
CH1189217826	1 1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-29 Series 553	6'130'000	CHF	101.23 %	6'205'399.00	0.35
CH1189217834	1.70 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-32 Series 554	5'490'000	CHF	102.83 %	5'645'367.00	0.32
CH1189217842	1.90 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-42 Series 555	3'030'000	CHF	107.79 %	3'266'037.00	0.18
CH1189217909	1.65 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-32 Series 557	5'720'000	CHF	102.57 %	5'867'004.00	0.33
CH1189217917	1.80 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-36 Series 558	4'080'000	CHF	104.80 %	4'275'840.00	0.24
CH1189217925	1.40 % ZKB 22-29	850'000	CHF	100.35 %	852'975.00	0.05
CH1191066187	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-33 Series 720	7'030'000	CHF	101.60 %	7'142'480.00	0.40
CH1191066237	1 1/2 % Stadt Zuerich 22-52	980'000	CHF	105.30 %	1'031'940.00	0.06
CH1193213027	1 1/2 % Kanton Basel-Stadt 22-28	650'000	CHF	101.65 %	660'725.00	0.04
CH1193213076	1 3/4 % Basler KB 22-29 Series 1	2'860'000	CHF	102.15 %	2'921'490.00	0.16
CH1193213142	2.10 % Basler KB 23-33	4'610'000	CHF	105.90 %	4'881'990.00	0.27
CH1194355066	2 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-37 Series 722	5'610'000	CHF	112.10 %	6'288'810.00	0.35
CH1194355074	2 1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-52 Series 723	1'630'000	CHF	120.96 %	1'971'648.00	0.11
CH1194355116	2 1/8 % Nestle 22-30	750'000	CHF	104.80 %	786'000.00	0.04
CH1194355124	2 1/2 % Nestle 22-34	2'160'000	CHF	110.25 %	2'381'400.00	0.13
CH1196217017	2 5/8 % Romande Energie Holding 22-37	4'150'000	CHF	111.40 %	4'623'100.00	0.26
CH1199659975	1 7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-38 Series 725	3'260'000	CHF	106.18 %	3'461'468.00	0.19
CH1204259738	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-32 Series 726	2'150'000	CHF	100.36 %	2'157'740.00	0.12
CH1204259746	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-42 Series 727	4'400'000	CHF	101.77 %	4'477'880.00	0.25
CH1206367422	1.85 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-37 Series 560	7'410'000	CHF	105.30 %	7'802'730.00	0.44
CH1206367463	1.95 % Groupe E 22-27	1'000'000	CHF	101.50 %	1'015'000.00	0.06
CH1206367471	2.55 % Groupe E 22-32	980'000	CHF	106.70 %	1'045'660.00	0.06
CH1206367497	3 3/4 % dormakaba Finance 22-27	1'720'000	CHF	105.80 %	1'819'760.00	0.10
CH1206367539	2.20 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-34 Series 562	2'400'000	CHF	108.05 %	2'593'200.00	0.15
CH1206367596	2.35 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-37 Series 565	3'360'000	CHF	111.95 %	3'761'520.00	0.21
CH1206367638	1.85 % ZKB 22-27 Series 157	4'800'000	CHF	101.90 %	4'891'200.00	0.27
CH1206367679	1.45 % Kanton Zuerich 22-29	1'920'000	CHF	102.00 %	1'958'400.00	0.11

Numéro de valeur classe A :	2 094 395
Numéro de valeur classe B :	2 094 405
Numéro de valeur classe C :	2 094 415
Numéro de valeur classe Z :	21 342 270
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	19

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1209697551	1 1/4 % Thurgauer KB 22-29	2'570'000	CHF	99.25 %	2'550'725.00	0.14
CH1211713156	1.6075 % Credit Agricole next bank (Suisse) 22-27	1'300'000	CHF	100.35 %	1'304'550.00	0.07
CH1211713164	1.97 % Credit Agricole next bank (Suisse) 22-32	2'430'000	CHF	102.55 %	2'491'965.00	0.14
CH1214912029	2.05 % Luzerner KB 22-47	3'020'000	CHF	112.90 %	3'409'580.00	0.19
CH1216740667	2 1/8 % Basellandschaftliche KB 22-52	1'510'000	CHF	116.85 %	1'764'435.00	0.10
CH1217066583	1 7/8 % Basler KB 23-29	1'400'000	CHF	102.60 %	1'436'400.00	0.08
CH1217066591	2 % Basler KB 23-34	1'500'000	CHF	105.25 %	1'578'750.00	0.09
CH1218301955	2 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-32 Series 730	3'870'000	CHF	106.17 %	4'108'779.00	0.23
CH1218301963	2 1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-37 Series 731	3'385'000	CHF	110.74 %	3'748'549.00	0.21
CH1226543838	2 1/4 % Nestle 22-29	1'570'000	CHF	105.00 %	1'648'500.00	0.09
CH1226543846	2 5/8 % Nestle 22-35	1'450'000	CHF	112.50 %	1'631'250.00	0.09
CH1230759560	1.95 % Inselspital-Stiftung 23-26	3'310'000	CHF	100.90 %	3'339'790.00	0.19
CH1231094355	2 1/8 % Luzerner KB 23-32	2'800'000	CHF	105.25 %	2'947'000.00	0.16
CH1231094371	1.70 % Stadt Bern 23-33	980'000	CHF	104.15 %	1'020'670.00	0.06
CH1231094389	1.90 % Luzerner KB 23-31	2'930'000	CHF	103.50 %	3'032'550.00	0.17
CH1231094397	2 % Luzerner KB 23-38	3'260'000	CHF	108.40 %	3'533'840.00	0.20
CH1232107024	1 1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-27 Series 566	1'700'000	CHF	100.72 %	1'712'240.00	0.10
CH1232107032	1.70 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-30 Series 567	2'610'000	CHF	102.52 %	2'675'772.00	0.15
CH1232107131	2.05 % BCV 23-28	3'610'000	CHF	102.65 %	3'705'665.00	0.21
CH1239464550	1.90 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-38 Series 569	4'875'000	CHF	106.55 %	5'194'312.50	0.29
CH1239464568	2.10 % Ville de Lausanne 23-48	1'300'000	CHF	112.20 %	1'458'600.00	0.08
CH1239464634	2 1/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-38 Series 570	2'280'000	CHF	109.64 %	2'499'792.00	0.14
CH1239464667	2.20 % Stadt Winterthur 23-58	910'000	CHF	122.50 %	1'114'750.00	0.06
CH1239464691	3 % Alreal Holding 23-28	1'530'000	CHF	104.85 %	1'604'205.00	0.09
CH1239464725	2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-29 Series 571	3'260'000	CHF	103.93 %	3'388'118.00	0.19
CH1239464733	2.05 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-32 Series 572	3'510'000	CHF	105.52 %	3'703'752.00	0.21
CH1239464782	2.05 % Banque Cantonale de Neuchatel 23-28	490'000	CHF	102.45 %	502'005.00	0.03
CH1239464790	2.05 % Banca dello Stato del Cantone Ticino 23-30	1'470'000	CHF	103.35 %	1'519'245.00	0.08
CH1239494987	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-29 Series 732	3'910'000	CHF	102.31 %	4'000'321.00	0.22
CH1239494995	1 7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-33 Series 733	4'720'000	CHF	104.36 %	4'925'792.00	0.28
CH1243651903	2.4113 % Cembra Money Bank 23-29	2'040'000	CHF	103.00 %	2'101'200.00	0.12
CH1243651945	2 3/4 % KW Linth-Limmern 23-30	2'480'000	CHF	105.75 %	2'622'600.00	0.15
CH1243651952	1 7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-31 series 734	4'240'000	CHF	103.66 %	4'395'184.00	0.25
CH1255924404	2.70 % Ferring Holding 23-27	7'510'000	CHF	102.35 %	7'686'485.00	0.43
CH1255924412	3 1/4 % Ferring Holding 23-31	4'100'000	CHF	106.95 %	4'384'950.00	0.25
CH1255924420	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-33 Series 738	2'310'000	CHF	105.55 %	2'438'205.00	0.14
CH1255924438	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-38 Series 739	6'770'000	CHF	107.85 %	7'301'445.00	0.41
CH1266847073	2.55 % Kantonsspital Baden 23-38	1'430'000	CHF	109.40 %	1'564'420.00	0.09
CH1266847107	1.70 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-28 Series 574	1'630'000	CHF	101.86 %	1'660'318.00	0.09
CH1266847156	1.90 % Swissgrid 23-26	650'000	CHF	101.05 %	656'825.00	0.04
CH1266847172	2.40 % KEBAG 23-38	980'000	CHF	109.40 %	1'072'120.00	0.06
CH1266847214	1.85 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-31 Series 575	3'260'000	CHF	103.70 %	3'380'620.00	0.19
CH1266847255	1.80 % Banque Cantonale du Valais 23-29	2'610'000	CHF	102.30 %	2'670'030.00	0.15
CH1266847271	1.85 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-33 Series 578	4'260'000	CHF	104.41 %	4'447'866.00	0.25
CH1266847289	1.85 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-38 Series 579	3'910'000	CHF	106.65 %	4'170'015.00	0.23
CH1267329279	2.10 % BCV 23-32	2'930'000	CHF	104.45 %	3'060'385.00	0.17
CH1268922205	2 7/8 % OC Oerlikon Corporation 23-26	1'960'000	CHF	101.15 %	1'982'540.00	0.11
CH1270609485	1.85 % Valiant Bank 23-28	3'260'000	CHF	100.95 %	3'290'970.00	0.18

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1271007945	2.1125 % Raiffeisen Suisse 23-28	200'000	CHF	102.15 %	204'300.00	0.01
CH1273475397	1 7/8 % Nestle 23-29	1'040'000	CHF	102.80 %	1'069'120.00	0.06
CH1273475405	2 % Nestle 23-33	1'960'000	CHF	105.15 %	2'060'940.00	0.12
CH1274703110	1.8984 % Credit Agricole next bank (Suisse) 23-26	650'000	CHF	100.80 %	655'200.00	0.04
CH1274703144	1.60 % Luzerner KB 24-44	2'000'000	CHF	102.85 %	2'057'000.00	0.12
CH1276313256	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-40 Series 740	6'520'000	CHF	109.20 %	7'119'840.00	0.40
CH1276313314	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-33 Series 742	4'870'000	CHF	103.50 %	5'040'450.00	0.28
CH1276313322	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-38 Series 743	3'260'000	CHF	104.75 %	3'414'850.00	0.19
CH1279261163	1.70 % Stadt Zuerich 23-44	2'540'000	CHF	107.70 %	2'735'580.00	0.15
CH1280154290	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-43 Series 744	3'550'000	CHF	107.20 %	3'805'600.00	0.21
CH1280154308	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-33 Series 745	3'000'000	CHF	103.73 %	3'111'900.00	0.17
CH1280155040	1 3/4 % Aargauische KB 23-33	150'000	CHF	102.70 %	154'050.00	0.01
CH1280155461	1.80 % St.Galler KB 23-33	2'160'000	CHF	103.15 %	2'228'040.00	0.12
CH1289657111	2 % Emmi Finanz 23-28	1'000'000	CHF	102.20 %	1'022'000.00	0.06
CH1290222285	2 3/8 % Bank Julius Baer & Co, Guernsey Branch 23-27	1'300'000	CHF	102.15 %	1'327'950.00	0.07
CH1290222301	2.40 % Kantonsspital St. Gallen 23-33	3'560'000	CHF	107.20 %	3'816'320.00	0.21
CH1290222319	2 1/2 % Kantonsspital St. Gallen 23-38	3'780'000	CHF	109.65 %	4'144'770.00	0.23
CH1290222418	1 3/4 % Stadt Zuerich 23-41	2'150'000	CHF	108.05 %	2'323'075.00	0.13
CH1290222442	1.80 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-33 Series 580	5'000'000	CHF	103.94 %	5'197'000.00	0.29
CH1290222459	1.85 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-38 Series 581	3'000'000	CHF	106.20 %	3'186'000.00	0.18
CH1290222467	2 1/4 % Visa Payment Services 23-26	2'000'000	CHF	101.85 %	2'037'000.00	0.11
CH1290222566	2.30 % SGS 23-31	1'500'000	CHF	105.10 %	1'576'500.00	0.09
CH1290870950	2 1/8 % Sandoz Group 23-26	3'220'000	CHF	101.50 %	3'268'300.00	0.18
CH1290870968	2.60 % Sandoz Group 23-31 NT	2'000'000	CHF	104.70 %	2'094'000.00	0.12
CH1290975528	1.90 % Banque Cantonale de Fribourg 23-26	2'610'000	CHF	101.05 %	2'637'405.00	0.15
CH1291601941	1.52 % Credit Agricole next bank (Suisse) 24-33	2'000'000	CHF	100.30 %	2'006'000.00	0.11
CH1293237975	1.965 % ABB 23-26	1'010'000	CHF	101.55 %	1'025'655.00	0.06
CH1293714346	2 1/4 % Partners Group Holding 23-28	1'650'000	CHF	102.75 %	1'695'375.00	0.09
CH1293714361	2 3/8 % Inselspital-Stiftung 23-31	2'960'000	CHF	105.20 %	3'113'920.00	0.17
CH1293714379	2.52 % Inselspital-Stiftung 23-38	1'000'000	CHF	109.65 %	1'096'500.00	0.06
CH1300277717	1.82 % UBS Switzerland 23-26	1'200'000	CHF	100.80 %	1'209'600.00	0.07
CH1300277725	2.035 % UBS Switzerland 23-33	5'850'000	CHF	104.30 %	6'101'550.00	0.34
CH1300277808	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-43 Series 747	5'000'000	CHF	106.05 %	5'302'500.00	0.30
CH1300277840	1 7/8 % Nestle 23-31	1'000'000	CHF	103.65 %	1'036'500.00	0.06
CH1300277857	2 % Nestle 23-36	1'000'000	CHF	106.05 %	1'060'500.00	0.06
CH1300277865	2.30 % Bell Food Group 23-26	1'000'000	CHF	101.80 %	1'018'000.00	0.06
CH1300277899	2.60 % Lonza Swiss Finanz 23-31	2'500'000	CHF	104.65 %	2'616'250.00	0.15
CH1305916780	1.95 % Roche Kapitalmarkt 23-38	2'000'000	CHF	106.40 %	2'128'000.00	0.12
CH1305916814	1.45 % Stadt Zuerich 23-42	3'720'000	CHF	103.20 %	3'839'040.00	0.21
CH1306117073	1.45 % Kanton Zuerich 23-34	1'250'000	CHF	102.55 %	1'281'875.00	0.07
CH1306117149	1.30 % Stadt Zuerich 24-34	1'465'000	CHF	100.70 %	1'475'255.00	0.08
CH1307121272	2 3/8 % KW Linth-Limmern 23-29	1'000'000	CHF	103.80 %	1'038'000.00	0.06
CH1310346304	1 1/4 % Stadt Zuerich 24-33	2'000'000	CHF	100.50 %	2'010'000.00	0.11
CH1310346312	1.35 % Stadt Zuerich 24-45	2'000'000	CHF	102.25 %	2'045'000.00	0.11
CH1314941423	1.95 % Barry Callebaut 24-28	1'500'000	CHF	101.40 %	1'521'000.00	0.09
CH1314941431	2.30 % Barry Callebaut 24-32	1'500'000	CHF	103.55 %	1'553'250.00	0.09
CH1314941472	2.215 % Cembra Money Bank 24-30	1'550'000	CHF	101.90 %	1'579'450.00	0.09
CH1319968447	1.20 % Kanton Zuerich 24-30	1'900'000	CHF	100.65 %	1'912'350.00	0.11

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1319968454	2 % Nant de Drance 24-34	1'100'000	CHF	102.60 %	1'128'600.00	0.06
CH1319968538	1 1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-36 Series 589	4'970'000	CHF	101.70 %	5'054'490.00	0.28
CH1319968553	2 % ZKB 24-30	1'500'000	CHF	101.50 %	1'522'500.00	0.09
CH1319968587	2 3/8 % Bank Julius Baer & Co 24-31	4'810'000	CHF	101.479 %	4'881'139.90	0.27
CH1321481470	1.715 % UBS Switzerland 24-34	4'000'000	CHF	101.95 %	4'078'000.00	0.23
CH1323274089	1 5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 24-39 Series 750	1'750'000	CHF	103.35 %	1'808'625.00	0.10
CH1325807837	2.10 % Grande Dixence 24-32	900'000	CHF	102.45 %	922'050.00	0.05
CH1331113501	2 3/8 % Clariant 24-27	1'400'000	CHF	101.20 %	1'416'800.00	0.08
Suisse					1'290'794'402.87	72.20
CH0471298007	0.40 % Banco de Credito e Inversiones 19-24 NT	260'000	CHF	99.16 %	257'816.00	0.01
CH1112011601	0.33 % Banco Santander Chile 21-27 NT	2'795'000	CHF	94.55 %	2'642'672.50	0.16
CH1248666963	2.8925 % Banco de Credito e Inversiones 23-28 NT	1'300'000	CHF	102.95 %	1'338'350.00	0.07
CH1300950032	2.445 % Banco Santander Chile 24-27 NT	2'500'000	CHF	101.15 %	2'528'750.00	0.14
Chili					6'767'588.50	0.38
CH0520663664	1/2 % Banco Mercantile Del Norte 20-24	390'000	CHF	98.45 %	383'955.00	0.02
Caïmans (îles)					383'955.00	0.02
CH0235834154	1 1/2 % Deutsche Bahn Finance 14-24	2'120'000	CHF	100.00 %	2'120'000.00	0.12
CH0303138520	0.10 % Deutsche Bahn Finance 15-25	200'000	CHF	98.10 %	196'200.00	0.01
CH0479514272	0.10 % Deutsche Bahn Finance 19-29 NT Guaranteed	260'000	CHF	94.30 %	245'180.00	0.01
CH0481013768	0.20 % Muenchener Hypothekenbank 19-31	460'000	CHF	91.50 %	420'900.00	0.02
CH0517825334	0.10 % Muenchener Hypothekenbank 20-25	4'400'000	CHF	97.40 %	4'285'600.00	0.24
CH0522158887	0.20 % Deutsche Bahn Finance 21-33 NT	1'170'000	CHF	90.50 %	1'058'850.00	0.06
CH0561923837	1/4 % Muenchener Hypothekenbank 20-28	2'685'000	CHF	93.75 %	2'517'187.50	0.14
CH1122290237	0.05 % Muenchener Hypothekenbank 21-36	3'000'000	CHF	81.70 %	2'451'000.00	0.14
CH1137122797	1/4 % Deutsche Bahn Finance 21-31	1'460'000	CHF	92.65 %	1'352'690.00	0.08
CH1139995810	0.01 % Muenchener Hypothekenbank 21-26	1'300'000	CHF	96.60 %	1'255'800.00	0.07
CH1163572915	3/8 % Berlin Hyp 22-25	650'000	CHF	99.01 %	643'565.00	0.04
CH1195555409	1 1/4 % Muenchener Hypothekenbank 22-27	3'260'000	CHF	99.60 %	3'246'960.00	0.18
CH1202242249	0.9675 % Berlin Hyp 22-26	1'630'000	CHF	99.05 %	1'614'515.00	0.09
CH1204259811	1.95 % Deutsche Bahn Finance 22-32 NT	1'910'000	CHF	105.25 %	2'010'275.00	0.11
CH1227937708	2.5025 % E.ON 22-29 NT	720'000	CHF	105.05 %	756'360.00	0.04
CH1228838129	2.285 % Deutsche Bahn Finance 22-42 NT	1'300'000	CHF	114.60 %	1'489'800.00	0.08
CH1233900005	1 7/8 % Muenchener Hypothekenbank 23-30	5'770'000	CHF	102.65 %	5'922'905.00	0.35
CH1244731753	2 5/8 % DZ BANK 23-29	2'200'000	CHF	102.55 %	2'256'100.00	0.13
CH1244731795	2 1/8 % Berlin Hyp 23-26	3'550'000	CHF	101.00 %	3'585'500.00	0.20
CH1245295758	3.2625 % Commerzbank 23-27 NT	2'800'000	CHF	102.85 %	2'879'800.00	0.16
CH1261608900	2.8325 % DZ BANK 23-29	1'000'000	CHF	103.55 %	1'035'500.00	0.06
CH1264414322	3.80 % Commerzbank 23-28 NT	2'900'000	CHF	104.90 %	3'042'100.00	0.17
CH1271360609	1.6275 % NRW Bank 23-28 NT	3'410'000	CHF	102.15 %	3'483'315.00	0.19
CH1277080508	1.885 % Deutsche Bahn Finance 23-35	2'600'000	CHF	105.75 %	2'749'500.00	0.15
CH1293238007	2.2025 % DZ BANK 23-28	1'880'000	CHF	102.05 %	1'918'540.00	0.11
CH1294486365	3.61 % DZ BANK 23-28	2'800'000	CHF	103.00 %	2'884'000.00	0.16
CH1300277733	2 1/4 % Berlin Hyp 23-27	1'450'000	CHF	102.05 %	1'479'725.00	0.08

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1321481546	2.565 % Vonovia 24-29	2'500'000	CHF	102.00 %	2'550'000.00	0.14
Allemagne					59'451'867.50	3.33
CH0026985520	2 7/8 % Kommunekredit 06-31 NT	1'630'000	CHF	111.95 %	1'824'785.00	0.10
CH0285597370	5/8 % Kommunekredit 15-27 NT	360'000	CHF	98.35 %	354'060.00	0.02
CH1227937732	1 5/8 % Kommunekredit 23-30 NT	4'280'000	CHF	102.75 %	4'397'700.00	0.25
Danemark					6'576'545.00	0.37
CH0522690707	1/8 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 20-26 NT	1'800'000	CHF	96.30 %	1'733'400.00	0.10
CH1112011593	0.477 % CAIXABANK 21-27 Tranche 1 NT	2'000'000	CHF	95.90 %	1'918'000.00	0.11
CH1184694763	1.3275 % Banco Santander 22-25 NT	1'630'000	CHF	99.77 %	1'626'251.00	0.09
CH1227937724	2.2475 % Banco Santander 23-26 Series 176 NT	2'090'000	CHF	101.25 %	2'116'125.00	0.12
CH1228837899	2.4075 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 22-25 NT	1'400'000	CHF	101.35 %	1'418'900.00	0.08
CH1228837907	2.77 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 22-28	1'200'000	CHF	104.90 %	1'258'800.00	0.07
CH1276269755	2.7325 % Santander Consumer Finance 23-25 NT	1'860'000	CHF	101.42 %	1'886'412.00	0.11
CH1290871008	2.395 % Banco Santander 24-29 NT	2'500'000	CHF	102.00 %	2'550'000.00	0.14
CH1290871016	2.24 % Banco Santander 24-32	2'400'000	CHF	102.65 %	2'463'600.00	0.13
CH1325807886	2.175 % CAIXABANK 24-30 NT	1'400'000	CHF	100.70 %	1'409'800.00	0.08
Espagne					18'381'288.00	1.03
CH0185907083	1 3/8 % Municipality Finance 12-27 NT	200'000	CHF	100.60 %	201'200.00	0.01
CH0251885791	3/4 % Municipality Finance 14-24	1'430'000	CHF	99.67 %	1'425'281.00	0.08
CH0284415681	0.55 % Nordea Bank 15-25 NT	1'730'000	CHF	99.05 %	1'713'565.00	0.10
CH0361533125	5/8 % Municipality Finance 17-38	390'000	CHF	91.50 %	356'850.00	0.02
CH1194000316	1.81 % Nordea Bank 22-27 NT	200'000	CHF	100.55 %	201'100.00	0.01
CH1244321779	1 5/8 % Municipality Finance 23-28 NT	3'430'000	CHF	101.85 %	3'493'455.00	0.19
CH1244321803	1 1/2 % Nordic Investment Bank 23-28 NT	2'610'000	CHF	101.70 %	2'654'370.00	0.15
CH1264823514	2.49 % Nordea Bank 23-28 NT	800'000	CHF	103.15 %	825'200.00	0.05
Finlande					10'871'021.00	0.61
CH0024141100	2 1/2 % CFF 06-31 NT	230'000	CHF	107.10 %	246'330.00	0.01
CH0109155827	2 5/8 % Agence Francaise de Developpement 10-25 NT	200'000	CHF	101.02 %	202'040.00	0.01
CH0118886735	2 % SNCF Reseau 10-26 NT	1'300'000	CHF	101.90 %	1'324'700.00	0.07
CH0212937244	1 3/4 % CRH 13-25	1'960'000	CHF	100.30 %	1'965'880.00	0.11
CH0305398247	1/4 % Credit Agricole Home Loan 15-26 NT	200'000	CHF	97.55 %	195'100.00	0.01
CH0368825474	0.40 % Banque Federative du Credit Mutuel 17-25 NT	1'630'000	CHF	98.00 %	1'597'400.00	0.09
CH0379610972	0.60 % BFCM 17-27 NT	400'000	CHF	97.00 %	388'000.00	0.02
CH0386949348	0.30 % Caisse des Depots et Consignations 17-27 NT	1'400'000	CHF	96.70 %	1'353'800.00	0.08
CH0414510062	1/4 % Caisse des Depots et Consignations 18-25	800'000	CHF	98.75 %	790'000.00	0.04
CH0435590382	1/2 % Credit Agricole 18-28	3'140'000	CHF	96.10 %	3'017'540.00	0.17
CH0479514264	0.20 % Banque Federative du Credit Mutuel 19-26 NT	1'520'000	CHF	97.10 %	1'475'920.00	0.08
CH0506071205	0.15 % BNP Paribas 20-28 NT	2'800'000	CHF	93.75 %	2'625'000.00	0.15
CH0521617339	1/4 % Societe Generale 20-27 NT	1'600'000	CHF	95.55 %	1'528'800.00	0.09
CH0550413345	0.227 % SNCF 20-30 NT	1'370'000	CHF	93.30 %	1'278'210.00	0.07
CH0591979643	0 % Caisse des Depots et Consignations 21-28 NT	1'200'000	CHF	94.75 %	1'137'000.00	0.06
CH1142512347	0.5275 % BNP Paribas 22-28 NT	1'600'000	CHF	95.20 %	1'523'200.00	0.09
CH1179184416	0.89 % Compagnie de Financement Foncier 22-29	3'650'000	CHF	97.65 %	3'564'225.00	0.20

Numéro de valeur classe A :	2 094 395
Numéro de valeur classe B :	2 094 405
Numéro de valeur classe C :	2 094 415
Numéro de valeur classe Z :	21 342 270
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	23

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1187450817	1 1/2 % Banque Federative du Credit Mutuel 22-27	1'470'000	CHF	99.75 %	1'466'325.00	0.08
CH1213243913	3.0425 % Credit Agricole 22-27 NT	1'200'000	CHF	104.15 %	1'249'800.00	0.07
CH1218301971	2 5/8 % Societe Generale 22-26 NT	150'000	CHF	102.50 %	153'750.00	0.01
CH1227937716	2.4125 % BNP Paribas 23-28 NT	4'000'000	CHF	102.70 %	4'108'000.00	0.23
CH1231312674	1 3/4 % Caisse des Depots et Consignations 22-29 NT	1'800'000	CHF	102.60 %	1'846'800.00	0.10
CH1242969199	2.30 % Banque Federative du Credit Mutuel 23-27 NT	1'080'000	CHF	101.90 %	1'100'520.00	0.06
CH1244321761	2.63 % BNP Paribas 23-29 NT	2'000'000	CHF	104.75 %	2'095'000.00	0.12
CH1248666955	2.6175 % Societe Generale 23-30 NT	1'470'000	CHF	104.35 %	1'533'945.00	0.09
CH1249151049	1 3/4 % Caisse des Depots et Consignations 23-31 NT	3'800'000	CHF	102.75 %	3'904'500.00	0.22
CH1249416004	2.5413 % Credit Agricole 23-30	1'500'000	CHF	105.05 %	1'575'750.00	0.09
CH1251030107	1.903 % Compagnie de Financement Foncier 23-28	3'430'000	CHF	102.20 %	3'505'460.00	0.20
CH1256367207	2.5075 % Credit Agricole 23-27 NT	1'830'000	CHF	102.75 %	1'880'325.00	0.11
CH1268922189	1.825 % Credit Agricole Home Loan SFH 23-28	3'390'000	CHF	101.85 %	3'452'715.00	0.19
CH1271360567	1 5/8 % Credit Agricole next bank (Suisse) 22-29	3'260'000	CHF	102.65 %	3'346'390.00	0.19
CH1276269730	2.73 % Banque Federative du Credit Mutuel 23-30 NT	3'500'000	CHF	106.10 %	3'713'500.00	0.21
CH1277028440	1.985 % SNCF 23-33 NT	3'150'000	CHF	105.30 %	3'316'950.00	0.19
CH1277240938	2.7725 % La Banque Postale 23-27 NT	3'600'000	CHF	103.85 %	3'738'600.00	0.21
CH1277582008	2.34 % ENGIE 23-27 NT	3'130'000	CHF	102.10 %	3'195'730.00	0.18
CH1279261148	1.8375 % CFF 23-30 NT	5'720'000	CHF	102.65 %	5'871'580.00	0.30
CH1290870976	2.1225 % BNP Paribas 24-32	3'000'000	CHF	102.40 %	3'071'999.99	0.17
CH1290870992	1.5825 % SNCF 24-39 NT	1'000'000	CHF	101.90 %	1'019'000.00	0.06
CH1290871024	1.5125 % RATP 24-36 NT	3'000'000	CHF	102.15 %	3'064'500.00	0.17
CH1294486357	2.3625 % Credit Agricole 23-28 NT	1'700'000	CHF	103.15 %	1'753'550.00	0.10
CH1298957064	2.6825 % Societe Generale 23-29 NT	3'500'000	CHF	104.35 %	3'652'250.00	0.20
CH1305916905	1.8425 % Credit Agricole 24-30 NT	2'250'000	CHF	100.85 %	2'269'125.00	0.13
CH1305916913	1.35 % Compagnie de Financement Foncier 24-31 NT	3'500'000	CHF	99.65 %	3'487'750.00	0.20
CH1321113453	2.2225 % Banque Federative du Credit Mutuel 24-32 NT	3'000'000	CHF	103.15 %	3'094'500.00	0.17
CH1325807902	2.05 % Credit Agricole 24-34 NT	1'500'000	CHF	102.20 %	1'533'000.00	0.09
CH1336918763	2.225 % ALD 24-29 NT	4'570'000	CHF	100.90 %	4'611'130.00	0.26
France					102'825'589.99	5.75

CH0370634666	5/8 % Credit Agricole 17-24 NT	650'000	CHF	99.73 %	648'245.00	0.04
CH0465767769	1 % Credit Agricole 19-25 NT	4'200'000	CHF	99.00 %	4'158'000.00	0.23
CH0485445982	0 % Nationwide Building Society 19-25	995'000	CHF	98.35 %	978'582.50	0.05
CH1154887157	0.6025 % Lloyds Banking Group 22-29 NT	2'200'000	CHF	93.95 %	2'066'900.00	0.12
CH1167887277	0.8975 % NatWest Markets 22-25 NT	2'200'000	CHF	99.41 %	2'187'020.00	0.12
CH1199322384	0.9194 % Nationwide Building Society 22-25 Tranche 1	2'840'000	CHF	99.15 %	2'815'860.00	0.16
CH1204175124	1.915 % Nationwide Building Society 22-28 NT	3'460'000	CHF	100.85 %	3'489'410.00	0.20
CH1228837865	2.33 % UBS AG, London Branch 22-25 NT	1'700'000	CHF	101.35 %	1'722'950.00	0.10
CH1231312708	2.7825 % NatWest Markets 22-27 NT	1'800'000	CHF	103.55 %	1'863'900.00	0.10
CH1236363409	1.7575 % Nationwide Building Society 23-26	795'000	CHF	100.35 %	797'782.50	0.04
CH1236363417	2.0125 % Nationwide Building Society 23-30	2'960'000	CHF	103.25 %	3'056'200.00	0.17
CH1243018806	2.745 % Lloyds Banking Group 23-27 NT	3'800'000	CHF	101.50 %	3'857'000.00	0.22
CH1264823480	2.385 % UBS AG, London Branch 23-25	3'600'000	CHF	100.98 %	3'635'280.00	0.20
CH1264823498	2.55 % UBS AG, London Branch 23-29	3'200'000	CHF	104.60 %	3'347'200.00	0.19
CH1270825545	2.8575 % NatWest Markets 23-28	1'400'000	CHF	104.30 %	1'460'200.00	0.08
CH1280994281	1.87 % Lloyds Bank 23-27	4'970'000	CHF	101.70 %	5'054'490.00	0.27
CH1280994299	2.97 % Nationwide Building Society 23-27	2'200'000	CHF	102.75 %	2'260'500.00	0.13

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1292012775	2.01 % Santander UK 23-26 Series 82	2'560'000	CHF	101.50 %	2'598'400.00	0.15
Grande-Bretagne					45'997'920.00	2.57
CH0398677713	0.314 % CABEI 18-24 NT	520'000	CHF	99.43 %	517'036.00	0.03
CH0550103078	0.405 % CABEI 20-25 NT	2'275'000	CHF	98.49 %	2'240'647.50	0.13
CH1135555576	0.17 % CABEI 21-31 NT	1'240'000	CHF	87.30 %	1'082'520.00	0.06
CH1148308716	0.11 % CABEI 21-28 NT	2'160'000	CHF	92.60 %	2'000'160.00	0.11
CH1191066278	1.5462 % CABEI 22-26 NT	2'410'000	CHF	99.75 %	2'403'975.00	0.13
CH1231312682	2.1375 % CABEI 22-27 NT	1'860'000	CHF	101.25 %	1'883'250.00	0.11
Honduras					10'127'588.50	0.57
CH0419041543	1/4 % Intesa Sanpaolo Bank Ireland 19-24 NT	3'600'000	CHF	99.26 %	3'573'360.00	0.20
CH0419041634	1.195 % RZD Capital 19-28	300'000	CHF	11.10 %	33'300.00	0.00
CH0522690715	0.84 % RZD Capital 20-26 NT	4'575'000	CHF	15.25 %	697'687.50	0.04
Irlande					4'304'347.50	0.24
CH0461238856	0 % Korea Railroad 19-24 NT	5'410'000	CHF	99.04 %	5'358'064.00	0.29
CH0540633044	0.445 % The Korea Development Bank 20-25	290'000	CHF	98.82 %	286'578.00	0.02
CH1121837228	0.17 % The Korea Development Bank 21-31 NT	1'370'000	CHF	90.25 %	1'236'425.00	0.07
CH1216400056	2.155 % Korea Housing Finance 22-25	980'000	CHF	100.95 %	989'310.00	0.06
CH1216400064	2.465 % Korea Housing Finance 22-27	1'340'000	CHF	103.25 %	1'383'550.00	0.08
CH1243933574	1.815 % Korea Housing Finance 23-26	3'570'000	CHF	100.55 %	3'589'634.99	0.20
CH1243933582	1.8925 % Korea Housing Finance 23-28 Tranche 2	980'000	CHF	101.40 %	993'720.00	0.06
CH1271360633	2.1725 % Korea Water Resources 23-25	3'430'000	CHF	100.87 %	3'459'841.00	0.19
CH1271360641	2.0275 % Korea Railroad 23-25	1'000'000	CHF	100.75 %	1'007'500.00	0.06
CH1279261155	2.2225 % The Korea Development Bank 23-26 NT	2'890'000	CHF	101.75 %	2'940'575.00	0.16
CH1314941407	1.778 % Korea Housing Finance 24-27	1'750'000	CHF	100.80 %	1'764'000.00	0.10
Corée du Sud					23'009'197.99	1.29
CH0360677287	1/2 % LGT Bank 17-27	460'000	CHF	97.10 %	446'660.00	0.02
CH0484360372	3/8 % LGT Bank NT 19-28	1'600'000	CHF	94.50 %	1'512'000.00	0.08
CH1212189158	2 3/4 % LGT Bank 22-32	520'000	CHF	108.35 %	563'420.00	0.03
CH1243651929	2 1/2 % LGT Bank 23-33 NT	880'000	CHF	106.50 %	937'200.00	0.05
CH1306117040	2 1/2 % Liechtensteinische Landesbank 23-30 NT	3'400'000	CHF	102.95 %	3'500'300.00	0.21
Liechtenstein					6'959'580.00	0.39
CH0022333980	2 1/2 % Commerzbank Finance & Covered Bond 05-25	1'700'000	CHF	101.60 %	1'727'200.00	0.09
CH0398677689	0.732 % Aroundtown 18-25 NT	1'225'000	CHF	97.15 %	1'190'087.50	0.07
Luxembourg					2'917'287.50	0.16
CH0026233491	3 1/4 % NWB 06-29 NT	2'000'000	CHF	110.25 %	2'205'000.00	0.12
CH0190125036	1 3/8 % NWB 12-27 NT	3'420'000	CHF	100.65 %	3'442'230.00	0.19
CH0315593860	0.30 % ABN AMRO Bank 16-24	305'000	CHF	99.21 %	302'590.50	0.02
CH1121837244	0.55 % Digital Intrepid Holding 21-29 NT	1'170'000	CHF	91.85 %	1'074'645.00	0.06
CH1174335724	0.235 % Nederlandse Waterschapsbank 22-27 NT	650'000	CHF	97.15 %	631'475.00	0.04
CH1175016125	1.70 % Digital Intrepid Holding 22-27	1'605'000	CHF	98.85 %	1'586'542.50	0.09
CH1256367181	1.7925 % BNG Bank 23-28 NT	2'570'000	CHF	102.35 %	2'630'395.00	0.15

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1264823506	1.6875 % BNG Bank 23-30 NT	3'280'000	CHF	103.05 %	3'380'040.00	0.17
CH1273475421	2.30 % ABN AMRO Bank 23-25 Tranche 1 NT	3'000'000	CHF	101.04 %	3'031'200.00	0.17
CH1276269722	2.505 % ABN AMRO Bank 23-28 Tranche 2 NT	800'000	CHF	103.05 %	824'400.00	0.05
CH1296276152	2.47 % Achmea Bank 23-26 NT	2'600'000	CHF	102.00 %	2'652'000.00	0.15
CH1296276160	2.7475 % Achmea Bank 23-30 NT	1'000'000	CHF	104.20 %	1'042'000.00	0.06
CH1300224875	1.96 % MercedesBenz International Finance 23-26	1'200'000	CHF	101.25 %	1'215'000.00	0.07
Pays-Bas					24'017'518.00	1.34
CH1132966271	1/8 % SpareBank 1 Nord-Norge 21-28 NT	1'200'000	CHF	93.00 %	1'116'000.00	0.06
CH1174335815	0.545 % Kommunalbanken 22-28	910'000	CHF	97.25 %	884'975.00	0.05
CH1184694730	1.1675 % DNB Bank 22-27	2'120'000	CHF	98.60 %	2'090'320.00	0.11
CH1184694789	1 1/2 % SpareBank 1 SMN 22-27 NT	460'000	CHF	99.90 %	459'540.00	0.03
CH1230759537	1.275 % Kommunalbanken 22-27	1'230'000	CHF	100.30 %	1'233'690.00	0.07
CH1249416012	2.70 % SpareBank 1 Nord-Norge 23-29 NT	800'000	CHF	102.90 %	823'200.00	0.05
CH1271360583	1.81 % Kommunalbanken 23-30 NT	1'570'000	CHF	103.15 %	1'619'455.00	0.09
CH1290975932	1.8675 % Sparebank 1 Boligkreditt 23-28 NT	2'000'000	CHF	102.05 %	2'041'000.00	0.11
Norvège					10'268'180.00	0.57
CH0238765116	1 1/2 % Auckland Council 14-25 NT	550'000	CHF	100.35 %	551'925.00	0.03
CH0461238997	0.02 % Transpower New Zealand 19-27	1'730'000	CHF	95.35 %	1'649'555.00	0.09
CH0522158838	0.0375 % Transpower New Zealand 21-29	2'080'000	CHF	93.90 %	1'953'120.00	0.11
CH1216400080	1.66 % Auckland Council 22-27 NT	1'240'000	CHF	101.20 %	1'254'880.00	0.07
CH1290871032	1.3475 % Transpower New Zealand Limited 24-31	3'650'000	CHF	100.20 %	3'657'300.00	0.21
CH1305916749	1.56 % Auckland Council 23-29 NT	700'000	CHF	101.25 %	708'750.00	0.04
Nouvelle-Zélande					9'775'530.00	0.55
CH1191066245	0.80 % Asian Development Bank 22-27 NT	520'000	CHF	99.10 %	515'320.00	0.03
Philippines					515'320.00	0.03
CH0301549348	1/4 % Akademiska Hus 15-25	1'080'000	CHF	98.10 %	1'059'480.00	0.06
CH0373945085	0.30 % Akademiska Hus 17-29 NT	1'445'000	CHF	94.45 %	1'364'802.50	0.08
CH1184694714	1 1/4 % Svenska Handelsbanken 22-27 NT	1'300'000	CHF	99.45 %	1'292'850.00	0.07
CH1184694748	0.78 % Akademiska Hus 22-28 NT	650'000	CHF	97.75 %	635'375.00	0.04
CH1204259795	1.0225 % Swedisch Export Credit 22-27 Tranche 1 Reg S	2'350'000	CHF	99.15 %	2'330'025.00	0.13
CH1212189133	1.68 % Akademiska Hus 22-32 NT	2'520'000	CHF	102.10 %	2'572'920.00	0.14
CH1239494979	1.7125 % Aktiebolaget Svensk Exportkredit 23-30	2'380'000	CHF	102.05 %	2'428'790.00	0.14
CH1249416020	1.9925 % Akademiska Hus 23-33 NT	1'550'000	CHF	104.65 %	1'622'075.00	0.09
CH1271360401	2.7725 % Swedbank 23-28 NT	1'200'000	CHF	103.50 %	1'242'000.00	0.07
CH1271360419	1.8425 % Akademiska Hus 23-35	1'630'000	CHF	103.65 %	1'689'495.00	0.09
CH1331113576	2.0105 % Swedbank 24-30 NT	1'200'000	CHF	100.403 %	1'204'836.00	0.07
Suède					17'442'648.50	0.98
CH0271171685	3/8 % Apple 15-24	2'350'000	CHF	99.34 %	2'334'490.00	0.13
CH0278346769	1/4 % North American Development Bank 15-25	260'000	CHF	98.76 %	256'776.00	0.01
CH0362748276	0.20 % North American Development Bank 17-27	750'000	CHF	95.95 %	719'625.00	0.04
CH0367206676	1 % Verizon Communications 17-27	2'595'000	CHF	98.35 %	2'552'182.50	0.14
CH0373945044	3/8 % Jackson National Life Global Funding 17-25 NT	650'000	CHF	98.30 %	638'950.00	0.04

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0423233540	0.30 % North American Development Bank 18-26	2'250'000	CHF	97.60 %	2'196'000.00	0.12
CH0471297959	1/4 % New York Life Global Funding 19-27 NT Unitary 144A	2'350'000	CHF	95.75 %	2'250'125.00	0.13
CH0482172340	1/8 % Metropolitan Life Global Funding 19-27 NT Reg S	3'710'000	CHF	95.50 %	3'543'050.00	0.20
CH0517825268	1/8 % Jackson National Life Global Funding 20-28 Unitary 144	1'560'000	CHF	91.65 %	1'429'740.00	0.08
CH0545766542	0.20 % North American Development Bank 20-28	3'750'000	CHF	94.70 %	3'551'250.00	0.19
CH0545766559	0.55 % North American Development Bank 20-33	3'270'000	CHF	92.00 %	3'008'400.00	0.17
CH0564642095	1/8 % New York Life Global Funding 20-29 NT	3'030'000	CHF	92.45 %	2'801'235.00	0.16
CH1105672658	0.1925 % Verizon Communications 21-28	150'000	CHF	95.05 %	142'575.00	0.01
CH1105672682	1/8 % New York Life Global Funding NT 21-30	100'000	CHF	91.35 %	91'350.00	0.01
CH1137122839	1/4 % Pacific Life Global Funding II 21-28 NT	2'715'000	CHF	94.05 %	2'553'457.50	0.14
CH1179534982	1 3/8 % New York Life Global Funding 22-28 NT	1'830'000	CHF	99.40 %	1'819'020.00	0.10
CH1179534990	1 3/4 % Pacific Life Global Funding II 22-29 NT	2'000'000	CHF	100.40 %	2'008'000.00	0.11
CH1199659934	2.15 % Metropolitan Life Global Funding 22-26 Reg S	1'010'000	CHF	101.60 %	1'026'160.00	0.06
CH1255924461	2.65 % Massmutual Global Funding II 23-28 Series 2023-4	1'460'000	CHF	104.10 %	1'519'860.00	0.09
CH1271360625	2 7/8 % Equinix 23-28	2'160'000	CHF	103.00 %	2'224'800.00	0.12
CH1290871040	1 7/8 % Metropolitan Life Global Funding I 24-31 NT	3'040'000	CHF	100.784 %	3'063'833.60	0.17
CH1331113485	1.8401 % Thermo Fisher Scientific 24-32 NT	3'340'000	CHF	101.75 %	3'398'450.00	0.19
Etats-Unis					43'129'329.60	2.41
CH0270382093	1/2 % Corporacion Andina De Fomento 15-26	770'000	CHF	97.95 %	754'215.00	0.04
CH0315955903	0.304 % Corporacion Andina De Fomento 16-24	200'000	CHF	99.35 %	198'700.00	0.01
CH0360172727	0.30 % Andean Development Corporation 17-25 NT	590'000	CHF	98.69 %	582'271.00	0.03
CH0553331882	0.70 % Corporacion Andina De Fomento 20-25 NT	5'245'000	CHF	98.71 %	5'177'339.50	0.29
CH1151526238	0.45 % Andean Development Corporation 22-27 NT	1'370'000	CHF	96.10 %	1'316'570.00	0.07
CH1210198128	2.08 % Corporacion Andina De Fomento 22-28	2'770'000	CHF	100.85 %	2'793'545.00	0.16
CH1243933590	2.4275 % Corporacion Andina De Fomento 23-30	2'010'000	CHF	102.65 %	2'063'265.00	0.12
CH1300948796	2.5525 % Corporacion Andina De Fomento 23-29 NT	1'800'000	CHF	103.15 %	1'856'700.00	0.10
Vénézuéla					14'742'605.50	0.82
Valeurs mobilières non cotées en bourse						
Obligations					12'069'863.00	0.68
CH1331113592	1.42 % Federation Des Caisses Desjardins Du Quebec 24-30	3'700'000	CHF	100.095 %	3'703'515.00	0.21
Canada					3'703'515.00	0.21
CH1319968611	1.40 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-34 Series 590	4'000'000	CHF	100.544 %	4'021'760.00	0.23
CH1340267090	1.35 % Aargauische KB 24-31	2'500'000	CHF	100.188 %	2'504'700.00	0.14
Suisse					6'526'460.00	0.37
CH1321481538	2 1/2 % Muenchener Hypothekenbank 24-30	1'400'000	CHF	102.00 %	1'428'000.00	0.08
Allemagne					1'428'000.00	0.08
CH1341056450	1.5825 % Societe Nationale SNCF 24-39 NT	400'000	CHF	102.972 %	411'888.00	0.02
France					411'888.00	0.02

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
Valeurs mobilières évaluées selon un modèle						
Obligations					0.04	0.00
CH0379268748	2.10 % RZD Capital 17-23 NT	4'170'000	CHF	0.00 %	0.04	0.00
Irlande					0.04	0.00

Inventaire résumé	Valeur vénale	en %
Avoirs en banque à vue	10'706'558.17	0.60
Obligations, obligations convertibles, emprunts à option et autres titres de créance et droits-valeurs	1'761'366'924.99	98.52
Autres actifs	15'646'097.89	0.88
Fortune totale du fonds à la fin de la période comptable	1'787'719'581.05	100.00
Autres engagements	-1'316'342.58	
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	1'786'403'238.47	

Risques sur instruments financiers dérivés selon l'approche Commitment I

Engagement du fonds	% de la fortune nette	Montant
Total des positions augmentant l'engagement	0%	0
Total des positions réduisant l'engagement	0%	0
Informations supplémentaires et opérations hors-bilan		
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
Type et montant des sûretés acceptées		
Aucune sûreté acceptée		0
Contreparties pour les opérations over-the-counter (OTC)		
Aucune		

Liste des transactions pendant la période comptable

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
Positions ouvertes à la fin de la période comptable			
Obligations			
CH0008680370	4 % Confederation Suisse 98-28	2'260'000	8'800'000
CH0009755197	4 % Confederation Suisse 99-49	0	960'000
CH0015803239	3 1/2 % Confederation Suisse 03-33	700'000	780'000
CH0020498645	2 3/4 % Stadt Zuerich 05-25	400'000	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
CH0024484187	2.55 % Stadt Zuerich 06-36	2'000'000	0
CH0024524966	2 1/2 % Confederation Suisse 06-36	1'600'000	5'010'000
CH0025185676	3 % Eurofima 06-26	250'000	2'090'000
CH0026233491	3 1/4 % NWB 06-29 NT	2'060'000	60'000
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	1'000'000	2'680'000
CH0109155827	2 5/8 % Agence Francaise de Developpement 10-25 NT	200'000	0
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	850'000	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
CH0119729793	2 % ZKB 10-34 Series 115	150'000	0
CH0119983077	1 7/8 % Luzerner KB 10-35	150'000	0
CH0120168486	2 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 10-28 Series 533	550'000	800'000
CH0124338937	2 5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 11-31 Series 548	9'750'000	3'230'000
CH0127181029	2 1/4 % Confederation Suisse 11-31	1'000'000	2'790'000
CH0127181169	1 1/2 % Confederation Suisse 12-42	1'200'000	9'150'000
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	300'000	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	1'000'000	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	1'600'000	1'240'000

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)
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
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	900'000	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	350'000	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	495'000	1'330'000
CH0206992270	1 1/2 % Thurgauer KB 13-27	2'000'000	1'040'000
CH0208271541	3 % KW Linth-Limmern 13-48	200'000	450'000
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
CH0217825337	2 % Kanton St. Gallen 13-38	750'000	0
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	850'000	4'100'000
CH0224397007	2 % Confederation Suisse 14-64	300'000	100'000
CH0224397171	1/2 % Confederation Suisse 15-30	1'855'000	9'940'000
CH0224397338	1/2 % Confederation Suisse 16-58	300'000	2'680'000
CH0224397346	0 % Confederation Suisse 16-29	3'650'000	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	350'000	960'000
CH0235834154	1 1/2 % Deutsche Bahn Finance 14-24	450'000	1'130'000
CH0236516834	1 3/4 % Stadt Zuerich 14-29	2'000'000	0
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
CH0244175201	1 1/4 % Banque Cantonale de Fribourg 14-24	100'000	1'770'000
CH0245691537	1 3/4 % Nant de Drance 14-24	100'000	0
CH0251885791	3/4 % Municipality Finance 14-24	0	770'000
CH0252379802	1 7/8 % Mobimo Holding 14-24	400'000	640'000
CH0252703050	1 1/4 % KW Linth-Limmern 14-24	200'000	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
CH0256434603	3/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 14-24 Series 456	500'000	0
CH0257042173	2 % Swiss Prime Site Finance 14-24	0	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)
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	425'000	580'000
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	575'000	540'000
CH0266307377	5/8 % Kanton Bern 15-32	200'000	0
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
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	450'000	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	550'000	2'210'000
CH0274314787	3/4 % Basellandschaftliche KB 15-28	2'250'000	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
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
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	350'000	1'000'000
CH0288286385	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-25 Series 467	900'000	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	1'430'000	3'120'000
CH0293026222	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-31 Series 617	400'000	1'180'000
CH0297132364	1 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-36 Series 619	1'020'000	3'690'000
CH0297343565	1/2 % Kanton Solothurn 15-30 Tranche 2	100'000	350'000
CH0299297280	3/4 % ZKB 15-30 Series 135	400'000	1'010'000

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)
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	800'000	3'030'000
CH0303138520	0.10 % Deutsche Bahn Finance 15-25	200'000	0
CH0304755157	3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-34 Series 623	5'500'000	1'500'000
CH0305398247	1/4 % Credit Agricole Home Loan 15-26 NT	200'000	0
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	265'000	530'000
CH0307256450	0.60 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-35 Series 476	1'120'000	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	650'000	1'370'000
CH0312512640	1/4 % Graubuendner KB 16-28	0	350'000
CH0315593860	0.30 % ABN AMRO Bank 16-24	0	170'000
CH0315955903	0.304 % Corporacion Andina De Fomento 16-24	300'000	100'000
CH0319415938	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-32 Series 628	1'020'000	1'910'000
CH0319416126	0.04 % Stadt Bern 16-27	200'000	940'000
CH0319932767	0.40 % BCV 16-31	350'000	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
CH0328599235	0.06 % Aargauische KB 16-25	200'000	0
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
CH0331455342	0 % Kanton Basel-Stadt 16-29	550'000	0
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
CH0337645581	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-26 Series 485	300'000	1'180'000
CH0338330415	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-32 Series 639	800'000	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	450'000	860'000
CH0342587638	0.05 % ZKB 16-26 Series 140	200'000	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	15'670'000
CH0344958688	1/2 % Confederation Suisse 18-32	2'200'000	7'390'000

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
CH0352595851	0.20 % Banque Cantonale du Valais 17-26	150'000	0
CH0352595885	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-27 Series 489	1'600'000	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	450'000	260'000
CH0354836113	3/4 % Mobimo Holding 17-26	0	240'000
CH0357676177	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 17-29 Series 493	1'510'000	1'840'000
CH0358654975	0.10 % Roche Kapitalmarkt 17-24 Tranche 2	300'000	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	550'000	1'580'000
CH0361533125	5/8 % Municipality Finance 17-38	100'000	210'000
CH0361533232	7/8 % Ville de Lausanne 17-42	450'000	0
CH0362748276	0.20 % North American Development Bank 17-27	0	400'000
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	1'225'000	2'380'000
CH0373476040	1/2 % Banque Cler 17-25	0	210'000
CH0373476339	0.30 % ZKB 18-28 Series 142	1'000'000	350'000
CH0373476412	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 18-28 Series 499	1'230'000	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
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
CH0379610972	0.60 % BFCM 17-27 NT	400'000	0
CH0384125073	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-30 Series 655	1'150'000	280'000
CH0384125081	3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-38 Series 656	1'000'000	0

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	1'500'000	310'000
CH0397450724	1/4 % Basellandschaftliche KB 18-27	600'000	2'050'000
CH0398633229	1/2 % Zurich Compagnie d'Assurances 18-24 NT	350'000	1'320'000
CH0398633252	1 % Swiss Prime Site Finance 18-24	250'000	300'000
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
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
CH0406415262	0.15 % Stadt Winterthur 18-25	500'000	0
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
CH0414522273	0.10 % Luzerner KB 18-24	320'000	0
CH0419040800	0.41 % Luzerner KB 19-29	100'000	990'000
CH0419040842	0.55 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-31 Series 508	950'000	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	1'700'000	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	300'000	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
CH0419041147	3/8 % Basellandschaftliche KB 19-30	2'000'000	0
CH0419041188	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-34 Series 513	1'000'000	2'120'000
CH0419041238	1/8 % ZKB 19-29 Series 145	0	700'000
CH0419041337	0 % Valiant Bank 19-29	890'000	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	600'000	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

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)
CH0419041675	0 % Banque Valiant 19-25	390'000	2'020'000
CH0419042509	3/4 % Nestle 18-28	150'000	920'000
CH0423233524	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-29 Series 660	350'000	1'270'000
CH0423233540	0.30 % North American Development Bank 18-26	1'490'000	1'090'000
CH0428194242	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-28 Series 661	2'150'000	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	2'150'000	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	1'720'000	7'850'000
CH0440081401	0 % Confederation Suisse 19-39	900'000	9'260'000
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
CH0443027047	0.15 % Aargauische KB 18-24	300'000	230'000
CH0443057515	1/2 % Thurgauer KB 18-26	300'000	100'000
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	1'150'000	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	1'150'000	5'400'000
CH0461238997	0.02 % Transpower New Zealand 19-27	790'000	500'000
CH0461239029	1/8 % Banque Valiant 19-34	235'000	1'050'000
CH0461239045	0.05 % ZKB 20-31 Series 146	810'000	1'870'000
CH0461239086	0.05 % Basellandschaftliche KB 20-31	470'000	1'170'000
CH0465767769	1 % Credit Agricole 19-25 NT	800'000	2'200'000
CH0471297926	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-30 Series 671	5'680'000	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	420'000	1'900'000
CH0474977714	0.205 % First Abu Dhabi Bank 19-25	1'450'000	260'000
CH0474977730	0.80 % Grande Dixence 19-26	300'000	940'000
CH0479514264	0.20 % Banque Federative du Credit Mutuel 19-26 NT	1'000'000	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	340'000	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	320'000	1'480'000
CH0484360372	3/8 % LGT Bank NT 19-28	0	800'000
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

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)
CH0485252818	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-34 Series 676	1'865'000	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	400'000	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
CH0506071114	0 % Banque Cantonale de Fribourg 20-30	350'000	470'000
CH0506071130	0 % Luzerner KB 20-28	280'000	0
CH0506071163	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-31 Series 517	1'650'000	5'210'000
CH0506071171	0.02 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-40 Series 518	0	1'390'000
CH0506071205	0.15 % BNP Paribas 20-28 NT	400'000	1'400'000
CH0506071221	0 % ZKB 20-30 Series 147	320'000	340'000
CH0506071270	0.14 % Banque Cantonale de Fribourg 20-30	205'000	1'370'000
CH0506071288	0.01 % Aargauische KB 20-28	315'000	890'000
CH0506071296	0 % Kanton Luzern 20-30	0	1'040'000
CH0506071338	1/8 % Luzerner KB 20-32	1'750'000	610'000
CH0506071395	1/4 % Basler KB 21-36	250'000	0
CH0508785752	1/4 % Stadt Zuerich 19-39	350'000	1'880'000
CH0511762061	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-27 Series 682	915'000	2'140'000
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	1'390'000	330'000
CH0517825334	0.10 % Muenchener Hypothekenbank 20-25	400'000	2'200'000
CH0520663664	1/2 % Banco Mercantile Del Norte 20-24	200'000	210'000
CH0520663672	0.20 % Flughafen Zuerich 20-35	145'000	450'000
CH0521617297	0 % Banque Cantonale du Valais 20-29	400'000	0
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	350'000	920'000
CH0522158978	0.35 % St.Galler KB 22-31	0	700'000
CH0522158994	0.01 % Basellandschaftliche KB 22-26	200'000	0
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	850'000	1'410'000
CH0522690707	1/8 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 20-26 NT	400'000	800'000
CH0522690715	0.84 % RZD Capital 20-26 NT	200'000	0

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)
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	1'375'000	6'280'000
CH0528881201	1/4 % Canton de Geneve 20-28	500'000	170'000
CH0536892588	0.95 % SGS 20-26	0	900'000
CH0536892612	0.70 % Flughafen Zuerich 20-24	300'000	1'240'000
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	1'000'000	4'730'000
CH0536893339	0.15 % Swissgrid 20-34	300'000	1'300'000
CH0536893412	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-30 Series 526	1'470'000	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	640'000	1'430'000
CH0545754688	1/8 % Basler KB 20-32	100'000	900'000
CH0545766542	0.20 % North American Development Bank 20-28	675'000	1'860'000
CH0545766559	0.55 % North American Development Bank 20-33	350'000	1'610'000
CH0547243235	0.05 % Canton de Geneve 20-29	200'000	1'290'000
CH0550103078	0.405 % CABEI 20-25 NT	475'000	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	380'000	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	690'000	2'690'000
CH0557778310	1/4 % Confederation Suisse 21-35	1'050'000	14'290'000
CH0561923837	1/4 % Muenchener Hypothekenbank 20-28	485'000	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	140'000	770'000
CH0564642079	0.01 % Lindt & Spruengli 20-28	0	900'000
CH0564642095	1/8 % New York Life Global Funding 20-29 NT	1'200'000	970'000
CH0565650832	1/4 % Basellandschaftliche KB 20-32	180'000	980'000
CH0568056219	0.14 % Stadt St.Gallen 20-44	0	170'000
CH0569237669	0.20 % Canton de Geneve 20-35	385'000	1'050'000
CH0570576113	7/8 % Nant de Drance 20-29	215'000	1'330'000

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)
CH0570576121	0.05 % ZKB 20-32 Series 148	500'000	660'000
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	1'250'000	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	200'000	1'220'000
CH0591084253	0.57 % Raiffeisen Suisse 21-31 Series 2	600'000	1'100'000
CH0591979619	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-41 Series 697	375'000	130'000
CH0591979643	0 % Caisse des Depots et Consignations 21-28 NT	1'200'000	0
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
CH1105672658	0.1925 % Verizon Communications 21-28	250'000	100'000
CH1105672682	1/8 % New York Life Global Funding NT 21-30	100'000	0
CH1105672690	0.30 % Grande Dixence 21-28	0	140'000
CH1111392853	0 % Kanton Bern 21-33	0	700'000
CH1111392861	0.10 % Banque Cantonale du Valais 21-31	1'000'000	0
CH1112011510	0.05 % Province of Ontario 21-33	0	350'000
CH1112011593	0.477 % CAIXABANK 21-27 Tranche 1 NT	200'000	1'000'000
CH1112011601	0.33 % Banco Santander Chile 21-27 NT	450'000	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	950'000	450'000
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
CH1131931243	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-31 Series 538	800'000	3'250'000
CH1131931276	0 % Kantonsspital Winterthur 21-25	200'000	590'000

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)
CH1131931292	0 % Swissgrid 21-26	100'000	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	200'000	600'000
CH1132966339	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-36 Series 707	3'450'000	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	375'000	1'190'000
CH1137122797	1/4 % Deutsche Bahn Finance 21-31	260'000	700'000
CH1137122839	1/4 % Pacific Life Global Funding II 21-28 NT	360'000	1'360'000
CH1139995810	0.01 % Muenchener Hypothekenbank 21-26	2'000'000	700'000
CH1141700430	1/4 % Stadt Zuerich 21-51	1'200'000	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
CH1142754287	0.795 % FONPLATA 21-28	190'000	700'000
CH1145096165	0.435 % UBS Group 21-28	400'000	1'000'000
CH1145096181	0.1475 % First Abu Dhabi Bank 21-26 NT	200'000	0
CH1148266161	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-28 Series 709	600'000	1'790'000
CH1148308716	0.11 % CABEI 21-28 NT	350'000	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	900'000	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
CH1151526238	0.45 % Andean Development Corporation 22-27 NT	100'000	730'000
CH1154887157	0.6025 % Lloyds Banking Group 22-29 NT	400'000	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	400'000	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	500'000	1'500'000
CH1166151949	3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-35 Series 715	1'150'000	3'030'000
CH1166151972	1/2 % Hypo Vorarlberg Bank 22-27	250'000	780'000
CH1167887277	0.8975 % NatWest Markets 22-25 NT	400'000	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
CH1170565720	1.30 % Banque Cantonale de Neuchatel 22-32	0	170'000
CH1170565803	1.40 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-32 Series 551	1'900'000	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 NT	1'000'000	350'000
CH1174335781	1 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-30 Series 716	500'000	2'960'000

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)
CH1174335815	0.545 % Kommunalbanken 22-28	0	490'000
CH1175016125	1.70 % Digital Intrepid Holding 22-27	325'000	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
CH1179534990	1 3/4 % Pacific Life Global Funding II 22-29 NT	2'000'000	0
CH1179535013	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-32 Series 718	1'250'000	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	400'000	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
CH1189217719	1.30 % % Graubuendner KB 22-30	475'000	1'480'000
CH1189217768	1.70 % Kantonsspital Baselland 22-32	350'000	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	1'150'000	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	4'500'000	2'780'000
CH1189217917	1.80 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-36 Series 558	1'050'000	1'970'000
CH1189217925	1.40 % ZKB 22-29	300'000	350'000
CH1191066187	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-33 Series 720	1'400'000	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 % CABEI 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	1'250'000	1'390'000
CH1193213142	2.10 % Basler KB 23-33	6'350'000	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	3'350'000	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	400'000	1'040'000
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

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)
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	400'000	960'000
CH1206367422	1.85 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-37 Series 560	1'100'000	3'690'000
CH1206367463	1.95 % Groupe E 22-27	350'000	450'000
CH1206367471	2.55 % Groupe E 22-32	0	520'000
CH1206367497	3 3/4 % dormakaba Finance 22-27	350'000	830'000
CH1206367539	2.20 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-34 Series 562	2'400'000	0
CH1206367596	2.35 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-37 Series 565	2'950'000	1'040'000
CH1206367638	1.85 % ZKB 22-27 Series 157	750'000	2'450'000
CH1206367679	1.45 % Kanton Zuerich 22-29	250'000	1'030'000
CH1209697551	1 1/4 % Thurgauer KB 22-29	600'000	1'230'000
CH1210198128	2.08 % Corporacion Andina De Fomento 22-28	1'200'000	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	400'000	1'220'000
CH1212189133	1.68 % Akademiska Hus 22-32 NT	650'000	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
CH1214912029	2.05 % Luzerner KB 22-47	2'100'000	1'080'000
CH1216400049	2.87 % BAWAG 22-25	350'000	640'000
CH1216400056	2.155 % Korea Housing Finance 22-25	130'000	520'000
CH1216400064	2.465 % Korea Housing Finance 22-27	330'000	610'000
CH1216400080	1.66 % Auckland Council 22-27 NT	100'000	660'000
CH1216740667	2 1/8 % Basellandschaftliche KB 22-52	1'510'000	0
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	5'700'000	1'830'000
CH1218301963	2 1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-37 Series 731	850'000	1'560'000
CH1218301971	2 5/8 % Societe Generale 22-26 NT	150'000	0
CH1226543838	2 1/4 % Nestle 22-29	350'000	730'000
CH1226543846	2 5/8 % Nestle 22-35	150'000	780'000
CH1227937708	2.5025 % E.ON 22-29 NT	100'000	380'000
CH1227937716	2.4125 % BNP Paribas 23-28 NT	600'000	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	5'950'000	1'670'000
CH1228837865	2.33 % UBS AG, London Branch 22-25 NT	400'000	800'000
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

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)
CH1228838129	2.285 % Deutsche Bahn Finance 22-42 NT	150'000	700'000
CH1230759537	1.275 % Kommunalbanken 22-27	400'000	570'000
CH1230759560	1.95 % Inselspital-Stiftung 23-26	500'000	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 NT	250'000	990'000
CH1231312708	2.7825 % NatWest Markets 22-27 NT	400'000	800'000
CH1232107024	1 1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-27 Series 566	2'400'000	700'000
CH1232107032	1.70 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-30 Series 567	0	1'390'000
CH1232107131	2.05 % BCV 23-28	650'000	1'790'000
CH1233900005	1 7/8 % Muenchener Hypothekenbank 23-30	6'200'000	2'430'000
CH1233900013	2 3/8 % Hypo Vorarlberg Bank 23-26	410'000	610'000
CH1236363409	1.7575 % Nationwide Building Society 23-26	225'000	430'000
CH1236363417	2.0125 % Nationwide Building Society 23-30	1'150'000	1'040'000
CH1239464550	1.90 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-38 Series 569	2'825'000	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	160'000	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	5'250'000	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	500'000	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	1'450'000	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	600'000	1'800'000
CH1243651903	2.4113 % Cembra Money Bank 23-29	500'000	1'010'000
CH1243651929	2 1/2 % LGT Bank 23-33 NT	300'000	470'000
CH1243651945	2 3/4 % KW Linth-Limmern 23-30	1'350'000	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	700'000	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	700'000	990'000
CH1244321761	2.63 % BNP Paribas 23-29 NT	2'600'000	600'000
CH1244321779	1 5/8 % Municipality Finance 23-28 NT	5'000'000	1'570'000
CH1244321803	1 1/2 % Nordic Investment Bank 23-28 NT	4'000'000	1'390'000

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)
CH1244731753	2 5/8 % DZ BANK 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	800'000	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
CH1251030107	1.903 % Compagnie de Financement Foncier 23-28	500'000	1'720'000
CH1255924404	2.70 % Ferring Holding 23-27	1'300'000	3'790'000
CH1255924412	3 1/4 % Ferring Holding 23-31	600'000	2'080'000
CH1255924420	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-33 Series 738	350'000	1'040'000
CH1255924438	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-38 Series 739	5'200'000	3'430'000
CH1255924461	2.65 % Massmutual Global Funding II 23-28 Series 2023-4	2'160'000	700'000
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 23-28	0	520'000
CH1256367181	1.7925 % BNG Bank 23-28 NT	200'000	1'270'000
CH1256367207	2.5075 % Credit Agricole 23-27 NT	2'700'000	870'000
CH1261608900	2.8325 % DZ BANK 23-29	1'600'000	600'000
CH1264414322	3.80 % Commerzbank 23-28 NT	4'300'000	1'400'000
CH1264823431	2.04 % Province of Quebec 23-33 NT	3'590'000	1'200'000
CH1264823480	2.385 % UBS AG, London Branch 23-25	5'000'000	1'400'000
CH1264823498	2.55 % UBS AG, London Branch 23-29	4'800'000	1'600'000
CH1264823506	1.6875 % BNG Bank 23-30 NT	4'950'000	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	6'000'000	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 Bank 23-28	5'000'000	1'740'000
CH1270825545	2.8575 % NatWest Markets 23-28	2'200'000	800'000
CH1271007945	2.1125 % Raiffeisen Suisse 23-28	200'000	0
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

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)
CH1271360583	1.81 % Kommunalbanken 23-30 NT	2'400'000	830'000
CH1271360609	1.6275 % NRW Bank 23-28 NT	5'150'000	1'740'000
CH1271360625	2 7/8 % Equinix 23-28	3'200'000	1'040'000
CH1271360633	2.1725 % Korea Water Resources 23-25	5'150'000	1'720'000
CH1271360641	2.0275% Korea Railroad 23-25	1'000'000	0
CH1273475397	1 7/8 % Nestle 23-29	2'600'000	1'560'000
CH1273475405	2 % Nestle 23-33	4'500'000	2'540'000
CH1273475421	2.30 % ABN AMRO Bank 23-25 Tranche 1 NT	4'600'000	1'600'000
CH1274703110	1.8984 % Credit Agricole next bank (Suisse) 23-26	1'000'000	350'000
CH1274703144	1.60 % Luzerner KB 24-44	2'000'000	0
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	5'230'000	1'730'000
CH1276269755	2.7325 % Santander Consumer Finance 23-25 NT	2'760'000	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	7'300'000	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	4'050'000	900'000
CH1277080508	1.885 % Deutsche Bahn Finance 23-35	3'300'000	700'000
CH1277240938	2.7725 % La Banque Postale 23-27 NT	5'300'000	1'700'000
CH1277582008	2.34 % ENGIE 23-27 NT	4'450'000	1'320'000
CH1279261148	1.8375 % CFF 23-30 NT	8'150'000	2'430'000
CH1279261155	2.2225 % The Korea Development Bank 23-26 NT	4'300'000	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	3'000'000	0
CH1280155040	1 3/4 % Aargauische KB 23-33	150'000	0
CH1280155461	1.80 % St.Galler KB 23-33	3'200'000	1'040'000
CH1280994281	1.87 % Lloyds Bank 23-27	6'960'000	1'990'000
CH1280994299	2.97 % Nationwide Building Society 23-27	3'200'000	1'000'000
CH1289657095	1 7/8 % Hypo Vorarlberg Bank 23-30	4'150'000	1'360'000
CH1289657111	2 % Emmi Finanz 23-28	2'000'000	1'000'000
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	4'550'000	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
CH1290222442	1.80 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-33 Series 580	5'000'000	0
CH1290222459	1.85 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-38 Series 581	3'000'000	0
CH1290222467	2 1/4 % Viseca Payment Services 23-26	2'000'000	0
CH1290222566	2.30 % SGS 23-31	1'500'000	0
CH1290870950	2 1/8 % Sandoz Group 23-26	3'220'000	0
CH1290870968	2.60 % Sandoz Group 23-31 NT	2'000'000	0
CH1290870976	2.1225 % BNP Paribas 24-32	3'000'000	0

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)
CH1290870992	1.5825 % SNCF 24-39 NT	1'000'000	0
CH1290871008	2.395 % Banco Santander 24-29 NT	2'500'000	0
CH1290871016	2.24 % Banco Santander 24-32	2'400'000	0
CH1290871024	1.5125 % RATP 24-36 NT	3'000'000	0
CH1290871032	1.3475 % Transpower New Zealand Limited 24-31	3'650'000	0
CH1290871040	1 7/8 % Metropolitan Life Global Funding I 24-31 NT	3'040'000	0
CH1290975528	1.90 % Banque Cantonale de Fribourg 23-26	4'000'000	1'390'000
CH1290975932	1.8675 % Sparebank 1 Boligkreditt 23-28 NT	2'000'000	0
CH1291601941	1.52 % Credit Agricole next bank (Suisse) 24-33	2'000'000	0
CH1292012775	2.01 % Santander UK 23-26 Series 82	3'840'000	1'280'000
CH1293237975	1.965 % ABB 23-26	1'500'000	490'000
CH1293238007	2.2025 % DZ BANK 23-28	2'750'000	870'000
CH1293714346	2 1/4 % Partners Group Holding 23-28	2'450'000	800'000
CH1293714361	2 3/8 % Inselspital-Stiftung 23-31	4'000'000	1'040'000
CH1293714379	2.52 % Inselspital-Stiftung 23-38	1'000'000	0
CH1294486357	2.3625 % Credit Agricole 23-28 NT	1'700'000	0
CH1294486365	3.61 % DZ BANK 23-28	2'800'000	0
CH1296276152	2.47 % Achmea Bank 23-26 NT	2'600'000	0
CH1296276160	2.7475 % Achmea Bank 23-30 NT	1'000'000	0
CH1298957064	2.6825 % Societe Generale 23-29 NT	3'500'000	0
CH1300224875	1.96 % MercedesBenz International Finance 23-26	1'200'000	0
CH1300277717	1.82 % UBS Switzerland 23-26	1'200'000	0
CH1300277725	2.035 % UBS Switzerland 23-33	5'850'000	0
CH1300277733	2 1/4 % Berlin Hyp 23-27	1'450'000	0
CH1300277808	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-43 Series 747	5'000'000	0
CH1300277840	1 7/8 % Nestle 23-31	1'000'000	0
CH1300277857	2 % Nestle 23-36	1'000'000	0
CH1300277865	2.30 % Bell Food Group 23-26	1'000'000	0
CH1300277899	2.60 % Lonza Swiss Finanz 23-31	2'500'000	0
CH1300948796	2.5525 % Corporacion Andina De Fomento 23-29 NT	1'800'000	0
CH1300950032	2.445 % Banco Santander Chile 24-27 NT	2'500'000	0
CH1305916749	1.56 % Auckland Council 23-29 NT	700'000	0
CH1305916780	1.95 % Roche Kapitalmarkt 23-38	2'000'000	0
CH1305916814	1.45 % Stadt Zuerich 23-42	3'720'000	0
CH1305916905	1.8425 % Credit Agricole 24-30 NT	2'250'000	0
CH1305916913	1.35 % Compagnie de Financement Foncier 24-31 NT	3'500'000	0
CH1306117040	2 1/2 % Liechtensteinische Landesbank 23-30 NT	3'400'000	0
CH1306117073	1.45 % Kanton Zuerich 23-34	1'250'000	0
CH1306117149	1.30 % Stadt Zuerich 24-34	1'465'000	0
CH1307121272	2 3/8 % KW Linth-Limmern 23-29	1'000'000	0
CH1310346304	1 1/4 % Stadt Zuerich 24-33	2'000'000	0
CH1310346312	1.35 % Stadt Zuerich 24-45	2'000'000	0

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)
CH1314941381	2 1/8 % Hypo Vorarlberg Bank 24-27	1'500'000	0
CH1314941407	1.778 % Korea Housing Finance 24-27	1'750'000	0
CH1314941423	1.95 % Barry Callebaut 24-28	1'500'000	0
CH1314941431	2.30 % Barry Callebaut 24-32	1'500'000	0
CH1314941472	2.215 % Cembra Money Bank 24-30	1'550'000	0
CH1319968447	1.20 % Kanton Zuerich 24-30	1'900'000	0
CH1319968454	2 % Nant de Drance 24-34	1'100'000	0
CH1319968538	1 1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-36 Series 589	4'970'000	0
CH1319968553	2 % ZKB 24-30	1'500'000	0
CH1319968587	2 3/8 % Bank Julius Baer & Co 24-31	4'810'000	0
CH1319968611	1.40 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-34 Series 590	4'000'000	0
CH1321113453	2.2225 % Banque Federative du Credit Mutuel 24-32 NT	3'000'000	0
CH1321481470	1.715 % UBS Switzerland 24-34	4'000'000	0
CH1321481538	2 1/2 % Muenchener Hypothekenbank 24-30	1'400'000	0
CH1321481546	2.565 % Vonovia 24-29	2'500'000	0
CH1323274089	1 5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 24-39 Series 750	1'750'000	0
CH1325807837	2.10 % Grande Dixence 24-32	900'000	0
CH1325807886	2.175 % CAIXABANK 24-30 NT	1'400'000	0
CH1325807902	2.05 % Credit Agricole 24-34 NT	1'500'000	0
CH1331113485	1.8401 % Thermo Fisher Scientific 24-32 NT	3'340'000	0
CH1331113501	2 3/8 % Clariant 24-27	1'400'000	0
CH1331113576	2.0105 % Swedbank 24-30 NT	1'200'000	0
CH1331113592	1.42 % Federation Des Caisses Desjardins Du Quebec 24-30	3'700'000	0
CH1336918763	2.225 % ALD 24-29 NT	4'570'000	0
CH1340267090	1.35 % Aargauische KB 24-31	2'500'000	0
CH1341056450	1.5825 % Societe Nationale SNCF 24-39 NT	400'000	0

Positions fermées en cours de période comptable

Obligations			
ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0025826949	3 1/4 % SNCF Reseau 06-32 NT	35'000	35'000
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
CH0126977641	2 1/4 % Kanton Bern 11-26	0	1'350'000
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

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)
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
CH0190369378	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 12-33 Series 569	200'000	1'200'000
CH0192241278	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 12-27 Series 572	500'000	500'000
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
CH0211588949	1 5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 13-30 Series 581	500'000	500'000
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
CH0215064350	1 1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 13-28 Series 433	200'000	200'000
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
CH0235475354	1 5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 14-26 Series 445	600'000	1'150'000
CH0236122740	1 3/4 % SGS 14-24	300'000	3'200'000
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
CH0241926317	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 14-25 Series 593	0	4'150'000
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

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)
CH0262085076	7/8 % Aargauische KB 15-30	100'000	100'000
CH0262286252	5/8 % BC Valais 14-23	300'000	300'000
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
CH0270190983	1/4 % Novartis 15-25	200'000	1'000'000
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
CH0282528899	7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-37 Series 611	0	3'350'000
CH0282857868	1/4 % Kanton Baselland 15-24	100'000	100'000
CH0282857876	3/4 % Kanton Baselland 15-32	100'000	100'000
CH0284687404	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-25 Series 613	480'000	1'330'000
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
CH0292984470	1 1/4 % Nant de Drance 15-23	320'000	2'970'000
CH0295186388	3/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-25 Series 469	400'000	5'700'000
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
CH0307256427	1/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-28 Series 475	350'000	350'000
CH0307256435	1/2 % PSP Swiss Property 16-24	150'000	5'750'000
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
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
CH0319415920	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-28 Series 627	650'000	650'000
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
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

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)
CH0336587735	0.18 % Cembra Money Bank 16-23	0	950'000
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
CH0347556885	0.30 % Metropolitan Life Global Funding 17-26 NT Series 144	250'000	1'000'000
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
CH0353945378	0.01 % Kanotn Zuerich 17-26	750'000	750'000
CH0357483160	2 % KW Linth-Limmern 17-23	500'000	4'410'000
CH0357676110	7/8 % Allreal Holding 17-27	50'000	750'000
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
CH0363645505	1/2 % Achmea Bank 17-23 NT	200'000	2'700'000
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
CH0373476966	3/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 18-33 Series 502	650'000	650'000
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
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
CH0398633807	0.70 % PSP Swiss Property 19-27 Reg S	0	600'000
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
CH0406415304	0.20 % Lansforsakringar Hypotek 18-26 NT	0	1'350'000
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
CH0423233516	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-25 Series 659	750'000	5'400'000
CH0423233565	0.30 % Jackson National Life Global Funding 18-23 NT	300'000	6'050'000
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
CH0441186506	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-27 Series 666	500'000	5'500'000
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
CH0459297435	7/8 % UBS Group 19-25	800'000	4'200'000
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
CH0463112042	0.578 % FONPLATA 19-24	450'000	1'790'000
CH0463112059	0.55 % Muenchener Hypothekenbank 19-34	100'000	100'000
CH0463112067	0.05 % DNB Bank 19-24	150'000	2'300'000
CH0463112075	7/8 % Societe Generale 19-24 NT	600'000	3'600'000
CH0465044680	0.401 % First Abu Dhabi Bank 19-24 NT	30'000	30'000

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)
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
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	1'570'000	1'570'000
CH0502393355	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-26 Series 680	400'000	400'000
CH0505011947	0.20 % Banco Santander 19-27	125'000	850'000
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
CH0511762038	0.5225 % Africa Finance 19-23 NT	350'000	4'365'000
CH0515152467	0.13 % Swisscom 20-31	0	500'000
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
CH0536892620	1 % Firmenich International 20-23	450'000	7'205'000
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
CH0569237677	1/8 % Metropolitan Life Global Funding 20-28 NT	370'000	370'000
CH0570576154	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-30 Series 528	400'000	400'000
CH0572327002	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-33 Series 694	310'000	310'000
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
CH1105672666	0.555 % Verizon Communications 21-31	100'000	2'000'000
CH1112011577	0.31 % Banco Santander 21-28 Tranche 1	0	500'000
CH1112455790	3/8 % OC Oerlikon Corporation 21-25	150'000	1'550'000
CH1118223424	0.10 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-32 Series 537	850'000	4'100'000
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

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)
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
CH1142512362	2.8925 % BNP Paribas 22-29 NT	200'000	1'800'000
CH1151526196	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-37 Series 712	300'000	3'300'000
CH1160382912	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-26 Series 713	300'000	300'000
CH1166151923	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-27 Series 714	500'000	500'000
CH1170565670	1 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-37 Series 549	0	1'250'000
CH1179184424	0.94 % The Korea Development Bank 22-27 NT	0	200'000
CH1187520460	1.4604 % Credit Agricole 22-27 NT	0	2'000'000
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
CH1206367588	2 1/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-30 Series 564	400'000	400'000
CH1211713222	1 1/2 % Roche Kapitalmarkt 22-26	150'000	150'000
CH1211713230	2 % Roche Kapitalmarkt 22-32	150'000	150'000
CH1214797131	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 33-34 Series 728	0	1'000'000
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
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
CH1249416038	2 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-26 Series 735	400'000	6'000'000
CH1249416087	2.30 % Geberit 23-32	100'000	2'550'000
CH1251030099	2 5/8 % ABN AMRO Bank 23-28	200'000	1'200'000
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
CH1273475413	2 1/8 % Nestle 23-38	3'750'000	3'750'000
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
CH1300277790	2.3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-37 Series 722	2'000'000	2'000'000
CH1305916731	2 3/8 % Givaudan 23-31	1'850'000	1'850'000
Instruments du marché monétaire			
CH1145908278	0 % Confederation Suisse 23-24 Series 3.0827	13'150'000	13'150'000

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

Situation jusqu'au 31.12.23

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 A	0.60%*	Max. 0.80%	
Classe B	0.30%*		
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 un tel cas, le taux annuel appliqué pour cette commission sera alors inférieur à celui indiqué dans le tableau ci-dessus.

Situation dès le 01.01.24

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		
		Commission d'émission en faveur des promoteurs de vente	Indemnité pour frais accessoires en faveur de la fortune du fonds	
			A l'émission	Au rachat
Classe A	0.60%*	Max. 1.00%	Max. 0.80%	Max. 0.50%
Classe B	0.30%*			
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 un tel cas, le taux annuel appliqué pour cette commission sera alors inférieur à celui indiqué dans le tableau ci-dessus.

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

		2021	2022	2023	2024 au 31 mars
Performance :					
– Classe A (lancée le 27.04.05)	%	-2.26	-11.97	6.52	0.50
– Classe B (lancée le 27.04.05)	%	-1.98	-11.71	6.83	0.59
– Classe C (lancée le 27.04.05)	%	-1.92	-11.66	6.87	0.60
– Classe Z (lancée le 10.01.19)	%	-1.71	-11.47	7.11	0.65

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.

Rapport abrégé de la société d'audit selon la loi sur les placements collectifs

à l'attention du Conseil d'administration de la direction de fonds Gérifonds SA, Lausanne

Rapport abrégé sur l'audit des comptes annuels

Opinion d'audit

Nous avons effectué l'audit des comptes annuels du fonds de placement AMC PROFESSIONAL FUND avec les compartiments :

- BCV CHF Domestic Corporate Bonds
- BCV CHF Foreign Bonds
- BCV Enhanced Europe Equity ESG
- BCV Enhanced US Equity ESG
- BCV Fiscal Strength Government Bonds
- BCV International Bonds (CHF)
- BCV Japac ESG
- BCV Pro Patrimoine CHF
- BCV Swiss Equity
- BCV Swiss Equity Dividend Select
- BCV Swiss Franc Bonds ESG
- BCV Swiss Franc Credit Bonds
- BCV Swiss Small & Mid Caps Equity
- BCV Systematic Premia Europe Equity ESG
- BCV Systematic Premia Swiss Equity
- BCV Systematic Premia US Equity ESG
- BCV Total Return Bonds (CHF)

– comprenant le compte de fortune au 31 mars 2024, le compte de résultat pour l'exercice clos à cette date, les indications relatives à l'utilisation du résultat et à la présentation des coûts ainsi que les informations supplémentaires selon l'art. 89, al. 1, let. b–h de la loi suisse sur les placements collectifs (LPCC).

Selon notre appréciation, les comptes annuels ci-joints sont conformes à la loi suisse sur les placements collectifs, aux ordonnances y relatives ainsi qu'au contrat de fonds et au prospectus.

Fondement de l'opinion d'audit

Nous avons effectué notre audit conformément à la loi suisse et aux Normes suisses d'audit des états financiers (NA-CH). Les responsabilités qui nous incombent en vertu de ces dispositions et de ces normes sont plus amplement décrites dans la section « Responsabilités de la société d'audit selon la loi sur les placements collectifs relatives à l'audit des comptes annuels » de notre rapport. Nous sommes indépendants du fonds de placement ainsi que de la direction de fonds, conformément aux dispositions légales suisses et aux exigences de la profession, et avons satisfait aux autres obligations éthiques professionnelles qui nous incombent dans le respect de ces exigences.

Nous estimons que les éléments probants recueillis sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion.

Responsabilités du Conseil d'administration de la direction de fonds relatives aux comptes annuels

Le Conseil d'administration de la direction de fonds est responsable de l'établissement des comptes annuels conformément à la loi suisse sur les placements collectifs, aux ordonnances y relatives ainsi qu'au contrat de fonds et au prospectus. Il est en outre responsable des contrôles internes qu'il juge nécessaires pour permettre l'établissement de comptes annuels ne comportant pas d'anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs.

Responsabilités de la société d'audit selon la loi sur les placements collectifs relatives à l'audit des comptes annuels

Notre objectif est d'obtenir l'assurance raisonnable que les comptes annuels pris dans leur ensemble ne comportent pas d'anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs, et de délivrer un rapport contenant notre opinion. L'assurance raisonnable correspond à un niveau élevé d'assurance, mais ne garantit toutefois pas qu'un audit réalisé conformément à la loi suisse et aux NA-CH permettra de toujours détecter toute anomalie significative qui pourrait exister. Les anomalies peuvent provenir de fraudes ou résulter d'erreurs et elles sont considérées comme significatives lorsqu'il est raisonnable de s'attendre à ce que, prises individuellement ou dans leur ensemble, elles puissent influencer les décisions économiques que les utilisateurs des comptes annuels prennent en se fondant sur ceux-ci.

Dans le cadre d'un audit conforme à la loi suisse et aux NA-CH, nous exerçons notre jugement professionnel tout au long de l'audit et faisons preuve d'esprit critique. En outre:

- Nous identifions et évaluons les risques que les comptes annuels comportent des anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs, concevons et mettons en œuvre des procédures d'audit en réponse à ces risques, et réunissons des éléments probants suffisants et appropriés pour fonder notre opinion d'audit. Le risque de non-détection d'une anomalie significative provenant de fraudes est plus élevé que celui d'une anomalie significative résultant d'une erreur, car la fraude peut impliquer la collusion, la falsification, des omissions volontaires, de fausses déclarations ou le contournement de contrôles internes.
- Nous acquérons une compréhension du système de contrôle interne de la direction de fonds pertinent pour l'audit afin de concevoir des procédures d'audit appropriées aux circonstances, mais non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du système de contrôle interne du fonds de placement.
- Nous évaluons le caractère approprié des méthodes comptables appliquées et le caractère raisonnable des estimations comptables ainsi que des informations y afférentes.

Nous communiquons au Conseil d'administration de la direction de fonds, notamment l'étendue des travaux d'audit et le calendrier de réalisation prévus et nos constatations d'audit importantes, y compris toute déficience majeure dans le système de contrôle interne, relevée au cours de notre audit.

PricewaterhouseCoopers SA

Jean-Sébastien Lassonde

Francis Brisson

Expert-réviseur agréé
Auditeur responsable

Genève, 11 juillet 2024

Annexe:

Comptes annuels comprenant le compte de fortune au 31 mars 2024, le compte de résultat pour l'exercice arrêté à cette date, des indications relatives à l'utilisation du résultat et à la présentation des coûts, ainsi que les informations supplémentaires selon l'art. 89, al. 1, let. b–h de la loi suisse sur les placements collectifs (LPCC)