

BCV INDEX FUND - BCV Swiss Responsible Bond Indexed

Rapport annuel au 31 août 2024

Table des matières

Direction du fonds et organisation	2
Information aux investisseurs	3
Utilisation du revenu net	3
Chiffres comptables	4
Inventaire et transactions	9
Notes aux états financiers	41
Rapport de performance	43
Rapport abrégé de la société d'audit	44



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

Simona TERRANOVA
Membre

Michel AUBRY
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

Information aux investisseurs

Aucune information aux investisseurs à communiquer pour le présent rapport annuel.

Utilisation du revenu net au 31 août 2024

Date Ex VNI : 17/12/2024

Date de paiement : 19/12/2024

Classe	Affidavit	Coupon n°	Monnaie	Montant pour porteurs de parts domiciliés			
				en Suisse		à l'étranger	
				Brut par part	Impôt anticipé fédéral moins 35%	Net par part	Net par part
Classe A	Non	1	CHF	0.25	0.0875	0.1625	0.1625
Classe B	Non	1	CHF	0.25	0.0875	0.1625	0.1625
Classe C	Non	1	CHF	0.25	0.0875	0.1625	0.1625
Classe Z	Non	1	CHF	0.30	0.105	0.195	0.195

Capitalisation des revenus

Capitalisation au : 17/12/2024

Classe	Affidavit	Monnaie	Montant pour porteurs de parts domiciliés en Suisse et à l'étranger	
			Rendement imposable	35% impôt anticipé récupérable
Classe CP ¹⁾	Non	CHF	0.29856	0.00000 ¹⁾
Classe ZP ¹⁾	Non	CHF	0.31945	0.00000 ¹⁾

¹⁾ La direction du fonds ayant déclaré l'impôt anticipé à l'Administration fédérale des contributions (AFC), les porteurs de part n'ont pas à soumettre de demande de remboursement de cet impôt

Chiffres comptables

Aperçu		Devise	(Lancement 16.05.24
			du fonds) 31.08.24
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	consolidée	CHF	252'820'413.80
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	classe A	CHF	102'582.55
Valeur nette d'inventaire d'une part à la fin de la période comptable	classe A	CHF	102.58
Total Expense Ratio (TER)	classe A		0.19%
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	classe B	CHF	864'419.19
Valeur nette d'inventaire d'une part à la fin de la période comptable	classe B	CHF	102.60
Total Expense Ratio (TER)	classe B		0.08%
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	classe C	CHF	6'655'226.69
Valeur nette d'inventaire d'une part à la fin de la période comptable	classe C	CHF	102.62
Total Expense Ratio (TER)	classe C		0.07%
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	classe CP	CHF	96'943'999.23
Valeur nette d'inventaire d'une part à la fin de la période comptable	classe CP	CHF	102.62
Total Expense Ratio (TER)	classe CP		0.07%
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	classe Z	CHF	106'741'471.47
Valeur nette d'inventaire d'une part à la fin de la période comptable	classe Z	CHF	102.64
Total Expense Ratio (TER)	classe Z		0.00%
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	classe ZP	CHF	41'512'714.67
Valeur nette d'inventaire d'une part à la fin de la période comptable	classe ZP	CHF	102.64
Total Expense Ratio (TER)	classe ZP		0.00%

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

Compte de fortune	
(Valeurs vénales)	31.08.24
Avoirs en banque	
à vue	397'210.80
Valeurs mobilières	
Obligations, obligations convertibles, emprunts à option et autres titres de créance et droits-valeurs	251'221'783.49
Autres actifs	1'551'453.76
Fortune totale du fonds à la fin de la période comptable	253'170'448.05
Autres engagements	-350'034.25
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	252'820'413.80

Evolution du nombre de parts de la classe A	Période comptable	(Lancement 16.05.24 du fonds) 31.08.24
Emission initiale		1'000
Position à la fin de la période comptable		1'000

Evolution du nombre de parts de la classe B	Période comptable	(Lancement 16.05.24 du fonds) 31.08.24
Emission initiale		1'000
Parts émises		7'425
Position à la fin de la période comptable		8'425

Evolution du nombre de parts de la classe C	Période comptable	(Lancement 16.05.24 du fonds) 31.08.24
Emission initiale		34'000
Parts émises		30'854
Position à la fin de la période comptable		64'854

Evolution du nombre de parts de la classe CP	Période comptable	(Lancement 16.05.24 du fonds) 31.08.24
Emission initiale		934'000
Parts émises		10'700
Position à la fin de la période comptable		944'700

Evolution du nombre de parts de la classe Z	Période comptable	(Lancement 16.05.24 du fonds) 31.08.24
Emission initiale		640'000
Parts émises		399'970
Position à la fin de la période comptable		1'039'970

Evolution du nombre de parts de la classe ZP	Période comptable (Lancement 16.05.24 du fonds) 31.08.24
Emission initiale	403'500
Parts émises	9'300
Parts rachetées	-8'350
Position à la fin de la période comptable	404'450

Variation de la fortune nette du fonds

Fortune nette du fonds à l'émission	201'350'000.00
Solde des mouvements de parts	44'982'962.37
Résultat total	6'487'451.43
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	252'820'413.80

Compte de résultat **Période comptable** (Lancement **16.05.24**
du fonds) **31.08.24**

Revenus	
Revenus des avoirs en banque à vue	1'228.95
Revenus des valeurs mobilières Obligations, obligations convertibles, emprunts à option et autres titres de créance et droits-valeurs	745'763.63
Participation des souscripteurs aux revenus nets courus	41'553.59
Total des revenus	788'546.17

Charges	
Bonifications réglementaires Commission forfaitaire de gestion	-20'901.02
Participation des porteurs de parts sortants aux revenus nets courus	-2'169.21
Total des charges	-23'070.23

Résultat net 765'475.94

Gains et pertes de capital réalisés 252'041.42

Résultat réalisé 1'017'517.36

Variation des gains et pertes de capital non réalisés 5'469'934.07

Résultat total 6'487'451.43

Utilisation du résultat de la classe A **Période comptable** (Lancement **16.05.24**
du fonds) **31.08.24**

Résultat net	262.78
Résultat disponible pour être réparti	262.78

Résultat prévu pour être distribué aux investisseurs 250.00

Report à compte nouveau 12.78

Total 262.78

Utilisation du résultat de la classe B **Période comptable** (Lancement **16.05.24**
du fonds) **31.08.24**

Résultat net	2'390.07
Résultat disponible pour être réparti	2'390.07

Résultat prévu pour être distribué aux investisseurs 2'106.25

Report à compte nouveau 283.82

Total 2'390.07

Période comptable (Lancement **16.05.24**

Utilisation du résultat de la classe C	du fonds) 31.08.24
Résultat net	19'362.35
Résultat disponible pour être réparti	19'362.35
Résultat prévu pour être distribué aux investisseurs	16'213.50
Report à compte nouveau	3'148.85
Total	19'362.35

Période comptable (Lancement **16.05.24**

Utilisation du résultat de la classe CP	du fonds) 31.08.24
Résultat net	282'046.84
Résultat disponible pour être réparti	282'046.84
Revenus thésaurisés (non distribués) et non soumis à l'impôt anticipé	282'046.84
Total	282'046.84

Période comptable (Lancement **16.05.24**

Utilisation du résultat de la classe Z	du fonds) 31.08.24
Résultat net	332'213.36
Résultat disponible pour être réparti	332'213.36
Résultat prévu pour être distribué aux investisseurs	311'991.00
Report à compte nouveau	20'222.36
Total	332'213.36

Période comptable (Lancement **16.05.24**

Utilisation du résultat de la classe ZP	du fonds) 31.08.24
Résultat net	129'200.54
Résultat disponible pour être réparti	129'200.54
Revenus thésaurisés (non distribués) et non soumis à l'impôt anticipé	129'200.54
Total	129'200.54

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					250'335'761.49	98.88
CH0593893925	0.068 % First Abu Dhabi Bank 21-27 NT	200'000	CHF	96.80 %	193'600.00	0.08
CH1145096181	0.1475 % First Abu Dhabi Bank 21-26 NT	200'000	CHF	97.50 %	195'000.00	0.08
CH1325807845	2.0125 % Abu Dhabi Commercial Bank 24-30	200'000	CHF	102.25 %	204'500.00	0.07
Emirats arabes unis					593'100.00	0.23
CH0340912168	0.65 % Transurban Queensland Finance Pty 16-26 NT	200'000	CHF	98.70 %	197'400.00	0.08
CH0458097950	1/4 % Westpac Banking 19-27	100'000	CHF	98.25 %	98'250.00	0.04
CH0512502995	0.113 % Commonwealth Bank of Australia 19-29 NT	250'000	CHF	94.65 %	236'625.00	0.09
CH1108704839	7/8 % Transurban Queensland Finance Pty 21-31 NT	200'000	CHF	95.85 %	191'700.00	0.08
CH1160188319	0.2925 % National Australia Bank 22-28 NT	200'000	CHF	97.50 %	195'000.00	0.08
CH1204175140	1.24 % Commonwealth Bank of Australia 22-29	100'000	CHF	101.15 %	101'150.00	0.04
CH1212189166	1.48 % Westpac Banking 22-26	400'000	CHF	101.10 %	404'400.00	0.16
CH1243651911	1.715 % National Australia Bank 23-33	200'000	CHF	105.25 %	210'500.00	0.08
CH1271360385	2.0125 % Westpac Banking 23-30	350'000	CHF	105.50 %	369'250.00	0.15
CH1273475389	1.94 % Commonwealth Bank of Australia 23-30	400'000	CHF	105.30 %	421'200.00	0.16
CH1289657137	2.201 % National Australia Bank 23-29	200'000	CHF	105.05 %	210'100.00	0.08
CH1357852792	0.96 % Treasury Corp of Victoria 24-34 NT	100'000	CHF	99.568 %	99'568.00	0.04
Australie					2'735'143.00	1.08
CH0020632144	2 7/8 % OEKB 05-30	300'000	CHF	111.05 %	333'150.00	0.15
CH0461238948	1 5/8 % Hypo Vorarlberg Bank 19-29 NT	200'000	CHF	93.65 %	187'300.00	0.07
CH0593893917	1/8 % Hypo Vorarlberg Bank 21-28	200'000	CHF	94.85 %	189'700.00	0.07
CH1166151972	1/2 % Hypo Vorarlberg Bank 22-27	300'000	CHF	98.75 %	296'250.00	0.12
CH1231094363	1.96 % BAWAG P.S.K. Versicherung 23-31	200'000	CHF	105.25 %	210'500.00	0.08
CH1233900013	2 3/8 % Hypo Vorarlberg Bank 23-26	200'000	CHF	102.00 %	204'000.00	0.08
CH1243018798	1.585 % AWAG P.S.K. Wohnbaubank 23-26 Series 23 Tranche 1	200'000	CHF	101.10 %	202'200.00	0.08
CH1271007952	2 3/8 % HYPO NOE Landesbank Niederoesterreich und Wien 24-29	200'000	CHF	103.00 %	206'000.00	0.08
CH1274703151	2.63 % Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich 23-28	300'000	CHF	103.95 %	311'850.00	0.12
Autriche					2'140'950.00	0.85
CH1142754287	0.795 % FONPLATA 21-28	200'000	CHF	94.35 %	188'700.00	0.07
CH1344316711	2.5925 % FONPLATA 24-27 NT	50'000	CHF	101.90 %	50'950.00	0.02
Bolivie					239'650.00	0.09
CH0367206759	1/4 % Province of Ontario 17-29	200'000	CHF	96.80 %	193'600.00	0.08
CH0461239003	1/8 % Province of New Brunswick 19-32	200'000	CHF	92.65 %	185'300.00	0.07
CH0461239011	1/4 % Province of New Brunswick 19-39	200'000	CHF	87.80 %	175'600.00	0.07
CH0528881227	1/4 % Alberta 20-28 NT	100'000	CHF	97.55 %	97'550.00	0.04

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	10

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0537261866	0.70 % Province of Manitoba 20-40 NT	200'000	CHF	93.80 %	187'600.00	0.07
CH1112011510	0.05 % Province of Ontario 21-33	350'000	CHF	92.05 %	322'175.00	0.13
CH1117896477	0.03 % Province of Quebec 21-31 NT	350'000	CHF	93.90 %	328'650.00	0.12
CH1163572931	0.525 % Province of Saskatchewan 22-32	200'000	CHF	97.05 %	194'100.00	0.08
CH1221150480	1.9575 % Banque Nationale du Canada 22-27	100'000	CHF	102.90 %	102'900.00	0.04
CH1264823431	2.04 % Province of Quebec 23-33 NT	200'000	CHF	108.50 %	217'000.00	0.09
CH1344316737	1.5225 % Province of Manitoba 24-34 NT	120'000	CHF	104.25 %	125'100.00	0.05
Canada					2'129'575.00	0.84
CH0008680370	4 % Confederation Suisse 98-28	2'400'000	CHF	112.44 %	2'698'560.00	1.07
CH0009755197	4 % Confederation Suisse 99-49	1'120'000	CHF	181.70 %	2'035'040.00	0.80
CH0015803239	3 1/2 % Confederation Suisse 03-33	2'120'000	CHF	125.61 %	2'662'932.00	1.05
CH0020469075	2 7/8 % Eurofima 05-30	400'000	CHF	110.60 %	442'400.00	0.17
CH0022566175	2 1/2 % Stadt Bern 05-25	150'000	CHF	101.73 %	152'595.00	0.06
CH0024484187	2.55 % Stadt Zuerich 06-36	300'000	CHF	118.45 %	355'350.00	0.14
CH0024524966	2 1/2 % Confederation Suisse 06-36	1'920'000	CHF	122.98 %	2'361'216.00	0.93
CH0025185676	3 % Eurofima 06-26	300'000	CHF	103.55 %	310'650.00	0.12
CH0031835561	3 1/4 % Confederation Suisse 07-27	1'380'000	CHF	107.64 %	1'485'432.00	0.59
CH0118095667	1 7/8 % Basler KB 10-26	150'000	CHF	101.80 %	152'700.00	0.06
CH0119015086	2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 10-25 Series 405	1'000'000	CHF	101.25 %	1'012'500.00	0.40
CH0119983077	1 7/8 % Luzerner KB 10-35	250'000	CHF	107.70 %	269'250.00	0.11
CH0120736852	2 % Luzerner KB 10-39	300'000	CHF	112.35 %	337'050.00	0.13
CH0122512152	2 5/8 % Raiffeisen Suisse 11-26	400'000	CHF	101.97 %	407'880.00	0.16
CH0124138840	2 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 11-27 Series 544	1'100'000	CHF	103.83 %	1'142'130.00	0.45
CH0126519047	2 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 11-26 Series 552	1'700'000	CHF	102.48 %	1'742'160.00	0.69
CH0126875803	2 1/2 % Stadt Bern 11-41	300'000	CHF	124.65 %	373'950.00	0.15
CH0127181029	2 1/4 % Confederation Suisse 11-31	1'540'000	CHF	111.80 %	1'721'720.00	0.68
CH0127181169	1 1/2 % Confederation Suisse 12-42	1'840'000	CHF	117.39 %	2'159'976.00	0.85
CH0127181193	1 1/4 % Confederation Suisse 12-37	2'030'000	CHF	109.87 %	2'230'361.00	0.88
CH0130158642	2 1/2 % ZKB 11-31 Series 122	500'000	CHF	109.70 %	548'500.00	0.22
CH0130614883	2 3/8 % Kanton Luzern 11-27	200'000	CHF	104.45 %	208'900.00	0.08
CH0136611800	1 3/4 % Ctrle EM de Logements CCL 11-26 Serie 42	300'000	CHF	101.90 %	305'700.00	0.12
CH0137992803	2 % Graubuendner KB 11-41	150'000	CHF	113.80 %	170'700.00	0.07
CH0147144361	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 12-28 Series 562	1'400'000	CHF	101.91 %	1'426'740.00	0.56
CH0180428531	2 7/8 % KW Linth-Limmern 12-42	100'000	CHF	113.85 %	113'850.00	0.04
CH0181932952	1 1/4 % Cantone del Ticino 12-27	400'000	CHF	101.30 %	405'200.00	0.16
CH0184636915	1 3/5 % Aargauische KB 12-37	150'000	CHF	105.80 %	158'700.00	0.06
CH0184911961	1 1/2 % Canton de Geneve 12-27	400'000	CHF	101.85 %	407'400.00	0.16
CH0187043820	1 3/8 % St.Galler KB 12-27	300'000	CHF	100.90 %	302'700.00	0.12
CH0194958960	3 % KW Linth-Limmern 12-52	100'000	CHF	120.70 %	120'700.00	0.05
CH0200044789	2 3/8 % Nant de Drance 13-28	300'000	CHF	103.65 %	310'950.00	0.12
CH0204276213	1 1/2 % Ville de Winterthour 13-36	300'000	CHF	105.90 %	317'700.00	0.13
CH0204365651	1 1/4 % Kanton Bern 13-28	300'000	CHF	101.45 %	304'350.00	0.12
CH0205276725	1 1/2 % Kanton Bern 13-29	250'000	CHF	103.10 %	257'750.00	0.10
CH0206992270	1 1/2 % Thurgauer KB 13-27	100'000	CHF	101.15 %	101'150.00	0.04
CH0207413185	1 7/8 % Cantone del Ticino 13-38	300'000	CHF	112.45 %	337'350.00	0.13
CH0208271541	3 % KW Linth-Limmern 13-48	220'000	CHF	121.40 %	267'080.00	0.11

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	11

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0208323458	1 3/4 % Canton de Geneve 13-33	300'000	CHF	107.45 %	322'350.00	0.13
CH0209002341	1 1/2 % Ville de Lausanne 13-28	200'000	CHF	102.30 %	204'600.00	0.08
CH0212459561	1 3/4 % Canton de Geneve 13-34	300'000	CHF	108.30 %	324'900.00	0.13
CH0214925874	1 1/2 % Kanton Baselland 13-28	400'000	CHF	102.70 %	410'800.00	0.16
CH0217850681	1 5/8 % Kanton Zuerich 13-26	400'000	CHF	101.60 %	406'400.00	0.16
CH0217850699	2 % Kanton Zuerich 13-38	300'000	CHF	115.65 %	346'950.00	0.14
CH0224396983	1 1/4 % Confederation Suisse 14-26	1'500'000	CHF	101.20 %	1'518'000.00	0.60
CH0224397007	2 % Confederation Suisse 14-64	1'450'000	CHF	163.00 %	2'363'500.00	0.93
CH0224397171	1/2 % Confederation Suisse 15-30	2'200'000	CHF	100.01 %	2'200'220.00	0.87
CH0224397338	1/2 % Confederation Suisse 16-58	1'570'000	CHF	103.24 %	1'620'868.00	0.64
CH0224397346	0 % Confederation Suisse 16-29	2'920'000	CHF	97.67 %	2'851'964.00	1.13
CH0224923513	1 3/4 % Schaffhauser KB 13-25	250'000	CHF	100.80 %	252'000.00	0.10
CH0237649964	2 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth 14-44 Series 589	480'000	CHF	119.66 %	574'368.00	0.23
CH0247776138	1 1/2 % Swisscom 14-26	550'000	CHF	100.95 %	555'225.00	0.22
CH0252903767	1 3/8 % Kanton Basel-Stadt 14-34	100'000	CHF	105.45 %	105'450.00	0.04
CH0263432988	1 % Centr. LdG Bques Cant. CH 14-28 Series 459	3'200'000	CHF	100.27 %	3'208'640.00	1.27
CH0267222310	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-30 Series 604	1'800'000	CHF	97.00 %	1'746'000.00	0.69
CH0267855986	1/8 % Kanton Baselland 15-26	250'000	CHF	99.01 %	247'525.00	0.10
CH0267855994	5/8 % Kanton Baselland 15-36	250'000	CHF	97.70 %	244'250.00	0.10
CH0268988182	1 % Swisscom 15-35 Tranche 2	200'000	CHF	97.60 %	195'200.00	0.08
CH0270190991	5/8 % Novartis 15-29	300'000	CHF	98.20 %	294'600.00	0.12
CH0272154177	1 % Kanton Baselland 15-40	300'000	CHF	102.35 %	307'050.00	0.12
CH0274253514	0.60 % Banque Cantonale de Fribourg 15-27	250'000	CHF	98.75 %	246'875.00	0.10
CH0274314787	3/4 % Basellandschaftliche KB 15-28	200'000	CHF	99.00 %	198'000.00	0.08
CH0275527882	5/8 % Aargauische KB 15-28	250'000	CHF	98.55 %	246'375.00	0.10
CH0278667115	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-30 Series 464	2'600'000	CHF	97.56 %	2'536'560.00	1.00
CH0279135328	7/8 % SGS 15-30	200'000	CHF	99.15 %	198'300.00	0.08
CH0280569135	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-34 Series 610	2'750'000	CHF	96.36 %	2'649'900.00	1.05
CH0282528907	1 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-45 Series 612	500'000	CHF	99.84 %	499'200.00	0.20
CH0284950505	1 1/8 % Stadt Zuerich 15-40	350'000	CHF	103.30 %	361'550.00	0.14
CH0285849367	5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-27 Series 466	300'000	CHF	99.16 %	297'480.00	0.12
CH0304755157	3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-34 Series 623	2'950'000	CHF	96.99 %	2'861'205.00	1.13
CH0306626224	2 % Nant de Drance 16-26	200'000	CHF	101.09 %	202'180.00	0.08
CH0310175564	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-26 Series 625	900'000	CHF	98.75 %	888'750.00	0.35
CH0310451858	1 1/4 % UBS Group Funding (Switzerland) 16-26 Tranche 2	400'000	CHF	100.19 %	400'760.00	0.16
CH0312512731	0.32 % Centrale d'Emission constr. Lgt CCL 16-36 Series 54	150'000	CHF	94.55 %	141'825.00	0.06
CH0319415938	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-32 Series 628	2'300'000	CHF	95.58 %	2'198'340.00	0.87
CH0319415987	1/2 % Coop-Gruppe Genossenschaft 16-26	200'000	CHF	98.90 %	197'800.00	0.08
CH0319416134	1/2 % Stadt Bern 16-36	300'000	CHF	95.35 %	286'050.00	0.11
CH0319932767	0.40 % BCV 16-31	400'000	CHF	95.05 %	380'200.00	0.15
CH0326213920	0.60 % Canton de Geneve 16-46	400'000	CHF	94.45 %	377'800.00	0.15
CH0330143188	0.02 % ZKB 16-27 Series 139	200'000	CHF	97.05 %	194'100.00	0.08
CH0330938892	0 % Rhaetische Bahn 16-25	150'000	CHF	99.13 %	148'695.00	0.06
CH0331455334	0 % Kanton Basel-Stadt 16-26	300'000	CHF	98.45 %	295'350.00	0.12
CH0336352775	1/8 % Swisscom 16-32	300'000	CHF	93.30 %	279'900.00	0.11
CH0336587719	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-27 Series 483	2'100'000	CHF	97.83 %	2'054'430.00	0.81
CH0336587727	1/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-31 Series 484	3'600'000	CHF	94.09 %	3'387'240.00	1.31

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	12

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0337645532	1/2 % Swiss Prime Site Finance 16-25	600'000	CHF	99.14 %	594'840.00	0.23
CH0338330415	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-32 Series 639	2'500'000	CHF	93.15 %	2'328'750.00	0.92
CH0338330472	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-36 Series 641	900'000	CHF	90.66 %	815'940.00	0.32
CH0342587638	0.05 % ZKB 16-26 Series 140	150'000	CHF	97.80 %	146'700.00	0.06
CH0343366792	0.05 % Kanton Bern 16-31	400'000	CHF	94.50 %	378'000.00	0.15
CH0344583841	0.20 % Kanton Solothurn 16-28	300'000	CHF	97.55 %	292'650.00	0.12
CH0344958472	1/2 % Confederation Suisse 17-55	1'340'000	CHF	102.10 %	1'368'140.00	0.54
CH0344958498	1/2 % Confederation Suisse 17-45	2'170'000	CHF	100.64 %	2'183'888.00	0.86
CH0344958688	1/2 % Confederation Suisse 18-32	1'860'000	CHF	100.12 %	1'862'232.00	0.74
CH0347082783	1/4 % ZKB 17-26 Series 141	250'000	CHF	98.91 %	247'275.00	0.10
CH0347082809	0.30 % Banque Cantonale de Fribourg 17-27	150'000	CHF	98.10 %	147'150.00	0.06
CH0352595851	0.20 % Banque Cantonale du Valais 17-26	200'000	CHF	98.71 %	197'420.00	0.08
CH0352595927	0.55 % SGS 17-26	250'000	CHF	99.01 %	247'525.00	0.10
CH0353105197	3/8 % Thurgauer KB 17-28	250'000	CHF	97.80 %	244'500.00	0.10
CH0358654942	0.60 % Canton de Geneve 17-38	300'000	CHF	96.35 %	289'050.00	0.11
CH0359915409	0.45 % Roche Kapitalmarkt 17-29 Tranche 3	300'000	CHF	97.65 %	292'950.00	0.12
CH0361532879	5/8 % Flughafen Zuerich 17-29	300'000	CHF	97.75 %	293'250.00	0.12
CH0361532903	3/4 % Kantonsspital Aarau 17-32	200'000	CHF	94.10 %	188'200.00	0.07
CH0361533067	1/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 17-25 Series 496	2'950'000	CHF	99.20 %	2'926'400.00	1.16
CH0361533166	0.60 % Ctrle EM de Logements CCL 17-35 Series 57	150'000	CHF	97.80 %	146'700.00	0.06
CH0362748359	3/8 % Swisscom 17-27	200'000	CHF	98.30 %	196'600.00	0.08
CH0373476107	0.70 % Stadt Zuerich 17-39	150'000	CHF	97.10 %	145'650.00	0.06
CH0373476222	3/4 % Allreal Holding 17-26	575'000	CHF	99.00 %	569'250.00	0.22
CH0373476339	0.30 % ZKB 18-28 Series 142	250'000	CHF	97.75 %	244'375.00	0.10
CH0373476438	0.30 % Graubuendner KB 18-26	500'000	CHF	98.98 %	494'900.00	0.20
CH0373476636	1.05 % Georg Fischer 18-28	200'000	CHF	99.15 %	198'300.00	0.08
CH0373476784	1/2 % Schaffhauser KB 18-28	250'000	CHF	98.00 %	245'000.00	0.10
CH0373945093	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-27 Series 653	3'200'000	CHF	97.94 %	3'134'080.00	1.24
CH0379354225	1/4 % Aargauische KB 17-26	150'000	CHF	98.35 %	147'525.00	0.06
CH0384629892	1 % dormakaba Finance 17-25	450'000	CHF	99.49 %	447'705.00	0.18
CH0387879049	1/2 % Canton de Geneve 17-31	400'000	CHF	97.70 %	390'800.00	0.15
CH0391491518	1/4 % BCV 17-25	500'000	CHF	98.85 %	494'250.00	0.20
CH0392885809	3/8 % Banca dello Stato del Cantone Ticino 18-28	300'000	CHF	97.55 %	292'650.00	0.12
CH0397450724	1/4 % Basellandschaftliche KB 18-27	100'000	CHF	98.10 %	98'100.00	0.04
CH0398633369	0.35 % Banque Cantonale de Neuchatel 18-26	150'000	CHF	98.45 %	147'675.00	0.06
CH0398633534	1 1/4 % SGS 18-28	400'000	CHF	100.20 %	400'800.00	0.16
CH0398633641	3/4 % Ctrle EM de Logements CCL 18-32 Series 60	450'000	CHF	99.60 %	448'200.00	0.18
CH0398633799	0.15 % ZKB 19-27 Series 144	300'000	CHF	97.95 %	293'850.00	0.12
CH0398633807	0.70 % PSP Swiss Property 19-27 Reg S	200'000	CHF	98.60 %	197'200.00	0.08
CH0398913498	0.20 % Banque Cantonale de Fribourg 18-26	150'000	CHF	98.75 %	148'125.00	0.06
CH0399611307	0.35 % Luzerner KB 18-27	100'000	CHF	98.30 %	98'300.00	0.04
CH0405985836	0.70 % Thurgauer KB 18-30	250'000	CHF	98.00 %	245'000.00	0.10
CH0407153359	3/8 % Basellandschaftliche KB 18-26	200'000	CHF	99.00 %	198'000.00	0.08
CH0413618353	0.70 % Kantonsspital Baden 18-28	300'000	CHF	97.00 %	291'000.00	0.11
CH0419040727	0.20 % Banque Valiant 19-27	250'000	CHF	97.80 %	244'500.00	0.10
CH0419040735	0.30 % Banque Cantonale du Valais 19-27	200'000	CHF	98.00 %	196'000.00	0.08
CH0419040792	3/4 % Zurich Compagnie d'Assurances 19-27 NT	200'000	CHF	99.20 %	198'400.00	0.08

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	13

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0419040891	1/2 % Kanton Basel-Stadt 19-34	350'000	CHF	97.55 %	341'425.00	0.13
CH0419040958	0.70 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-39 Series 510	2'200'000	CHF	95.25 %	2'095'500.00	0.83
CH0419041063	0.60 % Geberit 19-28	400'000	CHF	98.25 %	393'000.00	0.16
CH0419041071	5/8 % Ville de Bienne 19-27	300'000	CHF	98.85 %	296'550.00	0.12
CH0419041139	3/8 % Banque Cler 19-27	200'000	CHF	97.60 %	195'200.00	0.08
CH0419041238	1/8 % ZKB 19-29 Series 145	400'000	CHF	95.70 %	382'800.00	0.15
CH0419041378	5/8 % Aarekraftwerk Klingnau 19-29	200'000	CHF	97.10 %	194'200.00	0.08
CH0419041659	0.1525 % Cembra Money Bank 19-26	300'000	CHF	97.60 %	292'800.00	0.12
CH0419041675	0 % Banque Valiant 19-25	100'000	CHF	98.67 %	98'670.00	0.04
CH0419042509	3/4 % Nestle 18-28	300'000	CHF	99.05 %	297'150.00	0.12
CH0423233524	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-29 Series 660	2'300'000	CHF	98.12 %	2'256'760.00	0.89
CH0433761316	3/4 % Roche Kapitalmarkt 18-30	200'000	CHF	98.60 %	197'200.00	0.08
CH0434678378	0 % Kanton Luzern 18-25	150'000	CHF	99.14 %	148'710.00	0.06
CH0434678402	1 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-48 Series 664	200'000	CHF	102.72 %	205'440.00	0.08
CH0438965581	1 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-47 Series 665	560'000	CHF	103.00 %	576'800.00	0.23
CH0440081393	0 % Confederation Suisse 19-34	1'600'000	CHF	95.57 %	1'529'120.00	0.60
CH0440081401	0 % Confederation Suisse 19-39	1'730'000	CHF	93.28 %	1'613'744.00	0.64
CH0440081567	1 1/2 % Confederation Suisse 22-38	800'000	CHF	114.25 %	914'000.00	0.36
CH0446595685	0.40 % BLS 18-28	250'000	CHF	98.45 %	246'125.00	0.10
CH0446595693	0.95 % BLS 18-39	150'000	CHF	100.95 %	151'425.00	0.06
CH0459810534	1/8 % Aargauische KB 19-26	300'000	CHF	98.65 %	295'950.00	0.12
CH0461238864	3/8 % Stadler Rail 19-26	200'000	CHF	98.10 %	196'200.00	0.08
CH0461239029	1/8 % Banque Valiant 19-34	250'000	CHF	89.60 %	224'000.00	0.09
CH0461239045	0.05 % ZKB 20-31 Series 146	400'000	CHF	93.90 %	375'600.00	0.15
CH0461239086	0.05 % Basellandschaftliche KB 20-31	250'000	CHF	93.60 %	234'000.00	0.09
CH0461239102	0 % Swissgrid 20-28	400'000	CHF	96.00 %	384'000.00	0.15
CH0461239110	0.20 % Swissgrid 20-32	100'000	CHF	92.90 %	92'900.00	0.04
CH0465044649	0.10 % Stadt Winterthur 19-28	300'000	CHF	97.30 %	291'900.00	0.12
CH0474977730	0.80 % Grande Dixence 19-26	200'000	CHF	99.35 %	198'700.00	0.08
CH0482172399	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-41 Series 674	640'000	CHF	91.50 %	585'600.00	0.23
CH0485252875	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-49 Series 678	400'000	CHF	78.25 %	313'000.00	0.12
CH0485260902	0.10 % Banque Cantonale de Fribourg 19-44	300'000	CHF	82.10 %	246'300.00	0.10
CH0485261579	3/8 % Canton de Geneve 20-30	250'000	CHF	97.65 %	244'125.00	0.10
CH0485261603	0.35 % Ctrle EM de Logements CCL 20-40 Series 63	150'000	CHF	92.85 %	139'275.00	0.06
CH0488506681	3/8 % Swiss Prime Site Finance 19-31	200'000	CHF	92.60 %	185'200.00	0.07
CH0498589032	0.10 % Canton de Neuchatel 19-49	150'000	CHF	83.20 %	124'800.00	0.05
CH0502393355	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-26 Series 680	300'000	CHF	98.60 %	295'800.00	0.12
CH0505011913	0 % Canton de Geneve 19-28	300'000	CHF	97.00 %	291'000.00	0.11
CH0505011939	0.30 % Canton de Geneve 19-39	400'000	CHF	91.60 %	366'400.00	0.14
CH0506071106	0.01 % Aargauische KB 20-30	300'000	CHF	94.40 %	283'200.00	0.11
CH0506071130	0 % Luzerner KB 20-28	300'000	CHF	96.10 %	288'300.00	0.11
CH0506071171	0.02 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-40 Series 518	1'100'000	CHF	85.25 %	937'750.00	0.37
CH0506071213	1/4 % Mobimo Holding 20-28	200'000	CHF	96.05 %	192'100.00	0.08
CH0506071270	0.14 % Banque Cantonale de Fribourg 20-30	400'000	CHF	94.60 %	378'400.00	0.15
CH0506071296	0 % Kanton Luzern 20-30	200'000	CHF	95.65 %	191'300.00	0.08
CH0506071338	1/8 % Luzerner KB 20-32	400'000	CHF	92.20 %	368'800.00	0.15
CH0506071361	0.20 % PSP Swiss Property 21-31	200'000	CHF	92.90 %	185'800.00	0.07

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	14

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0506071395	1/4 % Basler KB 21-36	150'000	CHF	91.20 %	136'800.00	0.05
CH0515152467	0.13 % Swisscom 20-31	200'000	CHF	93.95 %	187'900.00	0.07
CH0520042513	1/2 % Bobst Group 20-26	300'000	CHF	98.50 %	295'500.00	0.12
CH0520663672	0.20 % Flughafen Zuerich 20-35	200'000	CHF	90.40 %	180'800.00	0.07
CH0521617297	0 % Banque Cantonale du Valais 20-29	250'000	CHF	95.10 %	237'750.00	0.09
CH0522158846	1/4 % St Galler KB 21-35	150'000	CHF	91.40 %	137'100.00	0.05
CH0522158861	0.40 % BCV 21-36	200'000	CHF	90.50 %	181'000.00	0.07
CH0522158895	0 % Kanton Luzern 21-31	400'000	CHF	94.85 %	379'400.00	0.15
CH0522158903	0.10 % Banque Valiant 21-30	150'000	CHF	93.75 %	140'625.00	0.06
CH0522159034	1.70 % Basellandschaftliche KB 22-42	100'000	CHF	110.35 %	110'350.00	0.04
CH0525158371	0.10 % Zurich Compagnie d'Assurances 20-32 NT	200'000	CHF	91.85 %	183'700.00	0.07
CH0536892588	0.95 % SGS 20-26	300'000	CHF	99.60 %	298'800.00	0.12
CH0536892737	0 % Kanton Zuerich 20-28	300'000	CHF	97.15 %	291'450.00	0.12
CH0536893511	0.10 % Centrale d'Emission constr. Lgt CCL 20-38 Series 64	150'000	CHF	90.25 %	135'375.00	0.05
CH0545754688	1/8 % Basler KB 20-32	300'000	CHF	92.40 %	277'200.00	0.11
CH0547243235	0.05 % Canton de Geneve 20-29	300'000	CHF	96.30 %	288'900.00	0.11
CH0547243276	3/4 % Sonova Holding 20-28	100'000	CHF	98.35 %	98'350.00	0.04
CH0557778310	1/4 % Confederation Suisse 21-35	1'630'000	CHF	97.84 %	1'594'792.00	0.63
CH0557778815	1 1/4 % Confederation Suisse 23-43	1'340'000	CHF	113.96 %	1'527'064.00	0.60
CH0557779003	7/8 % Confederation Suisse 24-47	510'000	CHF	108.80 %	554'880.00	0.22
CH0561923845	0.80 % Sulzer 20-25	600'000	CHF	99.14 %	594'840.00	0.23
CH0564642053	0.07 % Credit Agricole next bank (Suisse) 20-29	100'000	CHF	94.40 %	94'400.00	0.04
CH0564642061	0.35 % Lonza Swiss Finanz 20-26	200'000	CHF	98.30 %	196'600.00	0.08
CH0564642087	1/4 % Lindt & Spruengli 20-32	100'000	CHF	93.50 %	93'500.00	0.04
CH0565650832	1/4 % Basellandschaftliche KB 20-32	350'000	CHF	93.35 %	326'725.00	0.13
CH0570576113	7/8 % Nant de Drance 20-29	200'000	CHF	97.95 %	195'900.00	0.08
CH0572327002	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-33 Series 694	2'700'000	CHF	92.18 %	2'488'859.99	0.98
CH0572899257	1/2 % Raiffeisen Suisse 20-28	200'000	CHF	96.35 %	192'700.00	0.08
CH0589030946	0 % ZKB 21-33 Series 149	300'000	CHF	91.10 %	273'300.00	0.11
CH0591084253	0.57 % Raiffeisen Suisse 21-31 Series 2	300'000	CHF	93.90 %	281'700.00	0.11
CH1100259774	1/8 % Credit Agricole next bank (Suisse) 21-31	350'000	CHF	93.20 %	326'200.00	0.13
CH1100259790	0 % Cantone del Ticino 21-26	250'000	CHF	98.75 %	246'875.00	0.10
CH1101096522	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-28 Series 534	2'800'000	CHF	96.84 %	2'711'520.00	1.07
CH1101096621	0 % Kanton Zuerich 21-33	200'000	CHF	93.10 %	186'200.00	0.07
CH1101561525	1/4 % Holcim Helvetia Finance 21-27 NT	300'000	CHF	97.85 %	293'550.00	0.12
CH1111392853	0 % Kanton Bern 21-33	400'000	CHF	93.30 %	373'200.00	0.15
CH1111392861	0.10 % Banque Cantonale du Valais 21-31	300'000	CHF	93.05 %	279'150.00	0.11
CH1112011569	0 % Stadt Zuerich 21-30	1'000'000	CHF	95.20 %	952'000.00	0.38
CH1112246744	7/8 % Luzerner KB 21-31	200'000	CHF	95.65 %	191'300.00	0.08
CH1118223408	0.15 % Stiftung Kantonsspital Graubuenden 21-30	200'000	CHF	92.35 %	184'700.00	0.07
CH1118223499	0.30 % Kantonsspital St. Gallen 21-36	200'000	CHF	85.00 %	170'000.00	0.07
CH1127263965	0.05 % Canton de Geneve 21-41	250'000	CHF	86.05 %	215'125.00	0.08
CH1127263973	1/8 % Holcim Helvetia Finance 21-27 NT	300'000	CHF	96.65 %	289'950.00	0.11
CH1130818839	1/8 % Baloise-Holding 21-30	400'000	CHF	94.05 %	376'200.00	0.15
CH1131931276	0 % Kantonsspital Winterthur 21-25	200'000	CHF	98.40 %	196'800.00	0.08
CH1131931284	0.35 % Kantonsspital Baden 21-36	200'000	CHF	84.80 %	169'600.00	0.07
CH1131931300	1/4 % Allgemeine Baugenossenschaft Zuerich 21-31	200'000	CHF	92.10 %	184'200.00	0.07

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	15

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1131931326	0.10 % Primeo Holding 21-29	200'000	CHF	94.65 %	189'300.00	0.07
CH1132966297	0.03 % Credit Agricole next bank (Suisse) 21-31	200'000	CHF	92.60 %	185'200.00	0.07
CH1132966354	1/8 % Inselspital-Stiftung 21-29	200'000	CHF	93.35 %	186'700.00	0.07
CH1141700414	0.4175 % Cembra Money Bank 21-28	300'000	CHF	96.30 %	288'900.00	0.11
CH1141700547	0.20 % UBP 21-26	200'000	CHF	97.50 %	195'000.00	0.08
CH1145096165	0.435 % UBS Group 21-28	400'000	CHF	96.75 %	387'000.00	0.15
CH1146382481	3/8 % Emmi Finanz 21-31	100'000	CHF	94.65 %	94'650.00	0.04
CH1148266245	0.30 % Banque Cantonale du Valais 22-30	250'000	CHF	95.45 %	238'625.00	0.09
CH1148728210	0.30 % Baloise-Holding 22-27	300'000	CHF	98.00 %	294'000.00	0.12
CH1151526154	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-31 Series 710	2'500'000	CHF	93.87 %	2'346'750.00	0.93
CH1160382987	5/8 % Kanton Bern 22-35	300'000	CHF	97.70 %	293'100.00	0.12
CH1164800661	0.45 % Usines Electriques de l'Engadine 22-29	200'000	CHF	96.85 %	193'700.00	0.08
CH1166151899	1/2 % Roche Kapitalmarkt 22-27	400'000	CHF	98.95 %	395'800.00	0.16
CH1166151907	3/4 % Roche Kapitalmarkt 22-31	300'000	CHF	98.20 %	294'600.00	0.12
CH1166151923	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-27 Series 714	300'000	CHF	98.32 %	294'960.00	0.12
CH1170565720	1.30 % Banque Cantonale de Neuchatel 22-32	250'000	CHF	101.10 %	252'750.00	0.10
CH1170565761	1.55 % Bell Food Group 22-29	300'000	CHF	100.50 %	301'500.00	0.12
CH1170565795	1.10 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-28 Series 550	1'600'000	CHF	100.60 %	1'609'600.00	0.64
CH1172972825	1.77 % HIAG Immobilien Holding 22-26	200'000	CHF	100.10 %	200'200.00	0.08
CH1179534941	1.40 % Sonova Holding 22-32	200'000	CHF	100.90 %	201'800.00	0.08
CH1179535021	1 5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-38 Series 719	1'200'000	CHF	107.11 %	1'285'320.00	0.51
CH1189217719	1.30 % % Graubuendner KB 22-30	250'000	CHF	101.30 %	253'250.00	0.10
CH1189217768	1.70 % Kantonsspital Baselland 22-32	200'000	CHF	101.30 %	202'600.00	0.08
CH1189217859	1.90 % Ville de Berne 22-53	200'000	CHF	127.75 %	255'500.00	0.10
CH1189217867	2.10 % Daetwyler Holding 22-27	200'000	CHF	102.50 %	205'000.00	0.08
CH1193213076	1 3/4 % Basler KB 22-29 Series 1	400'000	CHF	103.40 %	413'600.00	0.16
CH1194000324	1.45 % Helvetia Compagnie Suisse d'Assurances 22-26 Tr 1	600'000	CHF	100.70 %	604'200.00	0.24
CH1194355074	2 1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-52 Series 723	420'000	CHF	131.98 %	554'316.00	0.22
CH1194355108	1 5/8 % Nestle 22-26	300'000	CHF	101.15 %	303'450.00	0.12
CH1194355124	2 1/2 % Nestle 22-34	500'000	CHF	112.60 %	563'000.00	0.22
CH1199659942	1 7/8 % Rhaetische Bahn 22-34	100'000	CHF	109.75 %	109'750.00	0.04
CH1206367471	2.55 % Groupe E 22-32	300'000	CHF	108.40 %	325'200.00	0.13
CH1206367521	2.10 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-30 Series 561	2'500'000	CHF	106.44 %	2'661'000.00	1.05
CH1206367570	1 5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-26 Series 563	600'000	CHF	101.11 %	606'660.00	0.24
CH1206367596	2.35 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-37 Series 565	2'450'000	CHF	116.02 %	2'842'490.00	1.12
CH1206367661	2.20 % Baloise-Holding 22-29	150'000	CHF	104.45 %	156'675.00	0.06
CH1206367679	1.45 % Kanton Zuerich 22-29	200'000	CHF	103.65 %	207'300.00	0.08
CH1211713214	2.0375 % TPG 22-34	150'000	CHF	107.85 %	161'775.00	0.06
CH1211713230	2 % Roche Kapitalmarkt 22-32	300'000	CHF	107.00 %	321'000.00	0.13
CH1214797131	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 33-34 Series 728	2'300'000	CHF	109.03 %	2'507'690.00	0.99
CH1214797198	2 3/8 % ABB 22-30	400'000	CHF	106.30 %	425'200.00	0.17
CH1214797206	2.3775 % Adecco Group 22-27 NT	200'000	CHF	103.30 %	206'600.00	0.08
CH1216740667	2 1/8 % Basellandschaftliche KB 22-52	100'000	CHF	128.05 %	128'050.00	0.05
CH1217066583	1 7/8 % Basler KB 23-29	250'000	CHF	104.05 %	260'125.00	0.10
CH1217066591	2 % Basler KB 23-34	100'000	CHF	107.50 %	107'500.00	0.04
CH1226543879	2.35 % Sika 22-28	300'000	CHF	104.95 %	314'850.00	0.12
CH1230759503	1.95 % Sonova Holding 22-30	200'000	CHF	104.25 %	208'500.00	0.08

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	16

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1230759560	1.95 % Inselspital-Stiftung 23-26	300'000	CHF	100.85 %	302'550.00	0.12
CH1231094355	2 1/8 % Luzerner KB 23-32	200'000	CHF	107.30 %	214'600.00	0.08
CH1231094371	1.70 % Stadt Bern 23-33	100'000	CHF	106.85 %	106'850.00	0.04
CH1231094389	1.90 % Luzerner KB 23-31	300'000	CHF	105.30 %	315'900.00	0.12
CH1231094397	2 % Luzerner KB 23-38	250'000	CHF	111.65 %	279'125.00	0.11
CH1232107032	1.70 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-30 Series 567	100'000	CHF	104.41 %	104'410.00	0.04
CH1232107057	2 % VAUDOISE ASSURANCES HOLDING 22-27	100'000	CHF	102.75 %	102'750.00	0.04
CH1232107073	1.55 % Rhaetische Bahn 22-38	100'000	CHF	109.60 %	109'600.00	0.04
CH1232107172	1 5/8 % Stadt Lugano 23-29	300'000	CHF	103.25 %	309'750.00	0.12
CH1239464659	1.95 % Ctrlle EM de Logements CCL 23-43	200'000	CHF	119.05 %	238'100.00	0.09
CH1239464691	3 % Allreal Holding 23-28	200'000	CHF	106.05 %	212'100.00	0.08
CH1239464709	2 3/4 % ZKB 23-28	300'000	CHF	103.90 %	311'700.00	0.12
CH1239464816	2 1/4 % PSP Swiss Property 23-28	200'000	CHF	103.80 %	207'600.00	0.08
CH1242301286	2.61 % Swiss Life Holding 23-32	300'000	CHF	109.25 %	327'750.00	0.13
CH1243651937	2.35 % KW Linth-Limmern 23-27	200'000	CHF	102.30 %	204'600.00	0.08
CH1243651945	2 3/4 % KW Linth-Limmern 23-30	200'000	CHF	107.35 %	214'700.00	0.08
CH1243651952	1 7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-31 series 734	1'500'000	CHF	105.60 %	1'584'000.00	0.63
CH1243651994	2.10 % Lonza Swiss Finanz 23-29	300'000	CHF	103.05 %	309'150.00	0.12
CH1243933566	3.13 % HIAG Immobilien Holding 23-29	100'000	CHF	105.50 %	105'500.00	0.04
CH1249416046	2 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-30 Series 736	1'800'000	CHF	106.96 %	1'925'280.00	0.76
CH1251998220	2.35 % Grande Dixence 23-30	200'000	CHF	105.25 %	210'500.00	0.08
CH1253456078	2 1/4 % Sika 23-26	300'000	CHF	101.70 %	305'100.00	0.12
CH1255924404	2.70 % Ferring Holding 23-27	200'000	CHF	102.90 %	205'800.00	0.08
CH1255924412	3 1/4 % Ferring Holding 23-31	200'000	CHF	108.65 %	217'300.00	0.09
CH1255924453	2.35 % Galenica 23-29	200'000	CHF	105.25 %	210'500.00	0.08
CH1265890660	1.45 % Kanton Bern 23-30	250'000	CHF	103.45 %	258'625.00	0.10
CH1265890736	1 1/2 % Stadt Winterthur 24-54	350'000	CHF	115.70 %	404'950.00	0.16
CH1265890801	1.60 % Basler KB 24-31 Series 004	100'000	CHF	103.50 %	103'500.00	0.04
CH1265890827	1.60 % Basler KB 24-44	250'000	CHF	109.70 %	274'250.00	0.11
CH1266477004	2.355 % Ville de Lausanne 23-74	200'000	CHF	153.25 %	306'500.00	0.12
CH1266847131	2.665 % Cembra Money Bank 23-30	400'000	CHF	105.85 %	423'400.00	0.17
CH1266847156	1.90 % Swissgrid 23-26	200'000	CHF	101.50 %	203'000.00	0.08
CH1266847172	2.40 % Kenova 23-38	300'000	CHF	113.00 %	339'000.00	0.13
CH1268922205	2 7/8 % OC Oerlikon Corporation 23-26	500'000	CHF	101.35 %	506'750.00	0.20
CH1270609485	1.85 % Valiant Bank 23-28	300'000	CHF	102.75 %	308'250.00	0.12
CH1273475397	1 7/8 % Nestle 23-29	500'000	CHF	104.00 %	520'000.00	0.21
CH1273475405	2 % Nestle 23-33	400'000	CHF	107.50 %	430'000.00	0.17
CH1273475413	2 1/8 % Nestle 23-38	200'000	CHF	111.50 %	223'000.00	0.09
CH1274703110	1.8984 % Credit Agricole next bank (Suisse) 23-26	100'000	CHF	101.50 %	101'500.00	0.04
CH1274703144	1.60 % Luzerner KB 24-44	600'000	CHF	109.30 %	655'800.00	0.26
CH1276313256	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-40 Series 740	200'000	CHF	114.01 %	228'020.00	0.09
CH1276313264	1 7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-50 Series 741	200'000	CHF	120.65 %	241'300.00	0.10
CH1276313314	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-33 Series 742	220'000	CHF	106.21 %	233'662.00	0.09
CH1280154290	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-43 Series 744	1'720'000	CHF	113.21 %	1'947'212.00	0.77
CH1280154324	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-49 Series 746	280'000	CHF	116.85 %	327'180.00	0.13
CH1280155461	1.80 % St.Galler KB 23-33	400'000	CHF	105.95 %	423'800.00	0.17
CH1289657111	2 % Emmi Finanz 23-28	200'000	CHF	102.95 %	205'900.00	0.08

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	17

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1290222285	2 3/8 % Bank Julius Baer & Co, Guernsey Branch 23-27	400'000	CHF	103.25 %	413'000.00	0.16
CH1290222293	2 1/2 % Bank Julius Baer & Co, Guernsey Branch 23-30	100'000	CHF	105.05 %	105'050.00	0.04
CH1290222301	2.40 % Kantonsspital St. Gallen 23-33	400'000	CHF	106.90 %	427'600.00	0.17
CH1290222327	1 7/8 % Ville de Lausanne 23-76	250'000	CHF	137.55 %	343'875.00	0.14
CH1290222509	1.70 % Cantone Ticino 23-33	100'000	CHF	107.55 %	107'550.00	0.04
CH1290222566	2.30 % SGS 23-31	200'000	CHF	106.90 %	213'800.00	0.08
CH1290870901	2 3/4 % Clariant 23-28 NT	200'000	CHF	104.05 %	208'100.00	0.08
CH1290870950	2 1/8 % Sandoz Group 23-26	300'000	CHF	101.75 %	305'250.00	0.12
CH1290870968	2.60 % Sandoz Group 23-31 NT	200'000	CHF	107.40 %	214'800.00	0.08
CH1290991327	1 1/8 % Basellandschaftliche KB 24-34	100'000	CHF	100.05 %	100'050.00	0.04
CH1293237975	1.965 % ABB 23-26	300'000	CHF	101.80 %	305'400.00	0.12
CH1293714346	2 1/4 % Partners Group Holding 23-28	200'000	CHF	104.10 %	208'200.00	0.08
CH1293714353	2.40 % Partners Group Holding 23-33	200'000	CHF	107.60 %	215'200.00	0.09
CH1293714361	2 3/8 % Inselehospital-Stiftung 23-31	200'000	CHF	105.45 %	210'900.00	0.08
CH1300277717	1.82 % UBS Switzerland 23-26	250'000	CHF	101.50 %	253'750.00	0.10
CH1300277725	2.035 % UBS Switzerland 23-33	400'000	CHF	107.45 %	429'800.00	0.17
CH1300277865	2.30 % Bell Food Group 23-26	200'000	CHF	102.10 %	204'200.00	0.08
CH1305916731	2 3/8 % Givaudan 23-31	200'000	CHF	107.50 %	215'000.00	0.08
CH1305916780	1.95 % Roche Kapitalmarkt 23-38	200'000	CHF	108.85 %	217'700.00	0.09
CH1305916814	1.45 % Stadt Zuerich 23-42	300'000	CHF	109.05 %	327'150.00	0.13
CH1306117107	1.30 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-28 Series 582	500'000	CHF	101.51 %	507'550.00	0.20
CH1306117131	1.70 % PSP Swiss Property 24-30	150'000	CHF	101.70 %	152'550.00	0.06
CH1310346312	1.35 % Stadt Zuerich 24-45	450'000	CHF	108.75 %	489'375.00	0.19
CH1310346320	1.30 % Cantone del Ticino 24-35	300'000	CHF	103.90 %	311'700.00	0.12
CH1314941423	1.95 % Barry Callebaut 24-28	200'000	CHF	101.50 %	203'000.00	0.08
CH1319968405	1 1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-31 Series 585	3'200'000	CHF	103.34 %	3'306'880.00	1.31
CH1319968496	1.80 % Swiss Prime Site Finance 24-30	200'000	CHF	101.80 %	203'600.00	0.08
CH1319968561	2 1/8 % ZKB 24-33	200'000	CHF	105.05 %	210'100.00	0.08
CH1319968611	1.40 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-34 Series 590	100'000	CHF	103.31 %	103'310.00	0.04
CH1319968629	1.40 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-38 Series 591	100'000	CHF	104.35 %	104'350.00	0.04
CH1319968694	1.45 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-39 Series 593	890'000	CHF	105.57 %	939'573.00	0.37
CH1321481462	1.5427 % UBS 24-27	150'000	CHF	101.05 %	151'575.00	0.06
CH1326849630	1.5775 % Ville de Lausanne 24-78	200'000	CHF	124.55 %	249'100.00	0.10
CH1337248970	1.20 % Kanton Bern 24-39	200'000	CHF	104.85 %	209'700.00	0.08
CH1341035009	1.5025 % Swiss Life Holding 24-30	100'000	CHF	101.45 %	101'450.00	0.04
CH1341035017	1.6575 % Swiss Life Holding 24-33	300'000	CHF	102.45 %	307'350.00	0.12
CH1344316745	1 3/8 % Nestle 24-28	50'000	CHF	101.50 %	50'750.00	0.02
CH1344316752	1 1/2 % Nestle 24-31	70'000	CHF	102.90 %	72'030.00	0.03
CH1344316760	1 5/8 % Nestle 24-34	160'000	CHF	104.25 %	166'800.00	0.07
CH1344316778	1 3/4 % Nestle 24-40	260'000	CHF	107.00 %	278'200.00	0.11
CH1346742856	2.10 % Kantonsspital Aarau 24-34	50'000	CHF	104.60 %	52'300.00	0.02
CH1346742864	1 1/2 % Banque Cantonale de Neuchatel 24-34	80'000	CHF	103.10 %	82'480.00	0.03
CH1346742898	1.65 % Visa Payment Services 24-28	100'000	CHF	101.30 %	101'300.00	0.04
CH1346742914	2.40 % St.Galler KB 24-34	280'000	CHF	105.00 %	294'000.00	0.12
CH1346742930	1.90 % Partners Group Holding 24-30	200'000	CHF	103.00 %	206'000.00	0.08
CH1346742989	1.45 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-34 Series 594	160'000	CHF	103.74 %	165'984.00	0.07
CH1346742997	1.45 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-39 Series 595	300'000	CHF	105.46 %	316'380.00	0.12

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	18

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1346743011	1.85 % WWZ 24-38	100'000	CHF	107.45 %	107'450.00	0.04
CH1346743029	2.05 % Mobimo Holding 24-30	150'000	CHF	102.90 %	154'350.00	0.06
CH1346743052	1.30 % Kanton Zuerich 24-37	650'000	CHF	106.05 %	689'325.00	0.27
CH1346743060	1 3/4 % Coop-Gruppe Genossenschaft 24-28	200'000	CHF	102.00 %	204'000.00	0.08
CH1346743078	1.85 % Coop-Gruppe Genossenschaft 24-32	200'000	CHF	103.95 %	207'900.00	0.08
CH1346743094	1.6 % Banca dello Stato del Cantone Ticino 24-36	250'000	CHF	104.20 %	260'500.00	0.10
CH1348614061	2.40 % Barry Callebaut 24-34	70'000	CHF	104.95 %	73'465.00	0.03
CH1348614129	1.65 % Sika 24-29	50'000	CHF	102.10 %	51'050.00	0.02
CH1348614137	1 7/8 % Sika 24-33	260'000	CHF	104.40 %	271'440.00	0.11
CH1348614145	1 3/4 % Baloise-Holding 24-34	100'000	CHF	103.10 %	103'100.00	0.04
CH1348614152	2.1125 % UBS Group 24-30 var	200'000	CHF	102.45 %	204'900.00	0.08
CH1348614194	1.30 % Stadt Zuerich 24-49	300'000	CHF	110.30 %	330'900.00	0.13
CH1348614202	1.5075 % UBS Switzerland 24-29	500'000	CHF	102.05 %	510'250.00	0.20
CH1348968657	1.60 % Graubuender KB 24-34	100'000	CHF	104.50 %	104'500.00	0.04
CH1350727785	1.65 % Swisscom 24-30 NT	300'000	CHF	103.00 %	309'000.00	0.12
CH1350727793	1.80 % Swisscom 24-34 NT	300'000	CHF	105.35 %	316'050.00	0.12
CH1350727801	2 % Swisscom 24-39 NT	120'000	CHF	107.95 %	129'540.00	0.05
CH1353015006	1 1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 24-28 Series 756	200'000	CHF	101.25 %	202'500.00	0.08
CH1353015022	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 24-37 Series 757	250'000	CHF	103.40 %	258'500.00	0.10
CH1353015030	1 1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 24-47 Series 758	100'000	CHF	105.12 %	105'120.00	0.04
CH1353257756	2 1/4 % Ferring Holding 24-29 Reg S	100'000	CHF	102.05 %	102'050.00	0.04
CH1353257814	1.65 % Novartis 24-31 NT	150'000	CHF	103.85 %	155'775.00	0.06
CH1353257822	1 3/4 % Novartis 24-34 NT	200'000	CHF	105.90 %	211'800.00	0.08
CH1353257830	1.85 % Novartis 24-40 NT	100'000	CHF	108.85 %	108'850.00	0.04
CH1353257848	1.85 % Novartis 24-49 NT	100'000	CHF	114.15 %	114'150.00	0.05
CH1353257863	1.95 % Helvetia Compagnie Suisse d'Assurances 24-34	200'000	CHF	105.35 %	210'700.00	0.08
CH1353257913	1.995 % EFG Bank 24-27	100'000	CHF	101.40 %	101'400.00	0.04
CH1353257921	2.1575 % EFG Bank 24-30	100'000	CHF	102.90 %	102'900.00	0.04
CH1353257939	1 5/8 % Kraftwerke Oberhasli 24-32	100'000	CHF	103.10 %	103'100.00	0.04
CH1357852651	1.6925 % Stadler Rail 24-29	100'000	CHF	101.35 %	101'350.00	0.04
CH1357852669	1.995 % Stadler Rail 24-32	100'000	CHF	102.15 %	102'150.00	0.04
CH1357852693	1.65 % Swiss Prime Site Finance 24-29	100'000	CHF	101.10 %	101'100.00	0.04
CH1361401719	1 1/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-33 Series 596	500'000	CHF	101.84 %	509'200.00	0.20
CH1361401727	1.30 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-39 Series 597	600'000	CHF	103.33 %	619'980.00	0.24
CH1361401735	1.30 % IWB Industrielle Werke Basel 24-29	100'000	CHF	101.25 %	101'250.00	0.04
CH1361401743	1.40 % IWB Industrielle Werke Basel 24-34	100'000	CHF	102.20 %	102'200.00	0.04
CH1361401842	1 1/8 % ZKB 24-34	100'000	CHF	100.20 %	100'200.00	0.04
CH1361401867	1.20 % BCV 24-36	100'000	CHF	99.30 %	99'300.00	0.04
CH1361401883	1 1/8 % Geberit 24-31	150'000	CHF	100.251 %	150'376.50	0.06
CH1366517105	1.13 % Thurgauer KB 24-44	200'000	CHF	100.60 %	201'200.00	0.08
CH1371736757	1 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 24-33 Series 759	500'000	CHF	99.81 %	499'050.00	0.20
CH1371736765	1 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 24-39 Series 760	300'000	CHF	100.91 %	302'730.00	0.12
CH1371736807	0.985 % Roche Kapitalmarkt 24-29	100'000	CHF	99.94 %	99'940.00	0.04
CH1371736815	1.0975 % Roche Kapitalmarkt 24-34	200'000	CHF	99.667 %	199'334.00	0.08
CH1371736823	1.17 % Roche Kapitalmarkt 24-39	100'000	CHF	99.279 %	99'279.00	0.04
Suisse					202'499'158.49	79.99

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	19

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0419041535	0.01 % Banco Del Estado De Chile 19-27 NT	200'000	CHF	95.25 %	190'500.00	0.08
CH0494734376	1/4 % Banco de Credito e Inversiones 19-29	100'000	CHF	93.15 %	93'150.00	0.04
CH0506071239	0.10 % Banco de Credito e Inversiones 20-26	200'000	CHF	97.35 %	194'700.00	0.08
CH1112011601	0.33 % Banco Santander Chile 21-27 NT	200'000	CHF	96.75 %	193'500.00	0.08
CH1120085696	0.385 % Banco de Credito e Inversiones 21-26 NT	200'000	CHF	97.45 %	194'900.00	0.08
CH1248666963	2.8925 % Banco de Credito e Inversiones 23-28 NT	200'000	CHF	104.60 %	209'200.00	0.08
CH1293714338	2.7175 % Embotelladora Andina 23-28	200'000	CHF	103.45 %	206'900.00	0.08
CH1300950032	2.445 % Banco Santander Chile 24-27 NT	200'000	CHF	101.95 %	203'900.00	0.07
CH1335850306	2.80 % Banco Internacional 24-27 NT	100'000	CHF	101.10 %	101'100.00	0.04
CH1348614160	2.0975 % Aguas Andinas 24-29	50'000	CHF	101.50 %	50'750.00	0.02
Chili					1'638'600.00	0.65
CH1271360575	1 3/4 % Asian Infrastructure Investment Bank 23-30 NT	200'000	CHF	104.70 %	209'400.00	0.08
Chine					209'400.00	0.08
CH0029008809	2 3/4 % KFW 07-37	200'000	CHF	122.35 %	244'700.00	0.10
CH0385997108	0.45 % Deutsche Bahn Finance 17-30 NT	300'000	CHF	96.85 %	290'550.00	0.11
CH0423233557	1/2 % Deutsche Bahn Finance 18-28 NT	200'000	CHF	98.45 %	196'900.00	0.08
CH0460872341	1/4 % Muenchener Hypothekenbank 19-29	200'000	CHF	96.80 %	193'600.00	0.08
CH0481013768	0.20 % Muenchener Hypothekenbank 19-31	200'000	CHF	94.50 %	189'000.00	0.07
CH0521333655	0.435 % Deutsche Telekom 20-32 NT	200'000	CHF	94.70 %	189'400.00	0.07
CH0522158887	0.20 % Deutsche Bahn Finance 21-33 NT	200'000	CHF	92.45 %	184'900.00	0.07
CH0593894006	1/4 % Muenchener Hypothekenbank 21-27 NT	200'000	CHF	97.20 %	194'400.00	0.08
CH0598928742	1/4 % Berlin Hyp 21-31	400'000	CHF	93.15 %	372'600.00	0.15
CH1100259808	1/4 % Muenchener Hypothekenbank 21-41	100'000	CHF	86.85 %	86'850.00	0.03
CH1160680166	0.40 % Muenchener Hypothekenbank 22-26	400'000	CHF	98.70 %	394'800.00	0.16
CH1175016091	3/8 % Muenchener Hypothekenbank 22-26	300'000	CHF	98.95 %	296'850.00	0.12
CH1195555409	1 1/4 % Muenchener Hypothekenbank 22-27	200'000	CHF	100.60 %	201'200.00	0.08
CH1204259811	1.95 % Deutsche Bahn Finance 22-32 NT	300'000	CHF	107.00 %	321'000.00	0.13
CH1227937708	2.5025 % E.ON 22-29 NT	200'000	CHF	106.30 %	212'600.00	0.08
CH1228838129	2.285 % Deutsche Bahn Finance 22-42 NT	100'000	CHF	117.65 %	117'650.00	0.05
CH1233900005	1 7/8 % Muenchener Hypothekenbank 23-30	200'000	CHF	104.60 %	209'200.00	0.08
CH1244731753	2 5/8 % DZ BANK 23-29	200'000	CHF	104.60 %	209'200.00	0.08
CH1245295758	3.2625 % Commerzbank 23-27 NT	400'000	CHF	103.70 %	414'800.00	0.16
CH1261608900	2.8325 % DZ BANK 23-29	200'000	CHF	105.10 %	210'200.00	0.08
CH1264414322	3.80 % Commerzbank 23-28 NT	200'000	CHF	107.20 %	214'400.00	0.08
CH1270825529	4.2525 % Muenchener Hypothekenbank 23-33 NT	200'000	CHF	106.85 %	213'700.00	0.08
CH1271360609	1.6275 % NRW Bank 23-28 NT	200'000	CHF	103.40 %	206'800.00	0.08
CH1277080508	1.885 % Deutsche Bahn Finance 23-35	400'000	CHF	107.90 %	431'600.00	0.17
CH1279261130	4.2425 % Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 23-33 NT	400'000	CHF	108.85 %	435'400.00	0.20
CH1294486365	3.61 % DZ BANK 23-28	300'000	CHF	103.75 %	311'250.00	0.12
CH1298665980	2.96 % Fresenius SE & Co. 23-28 NT	200'000	CHF	105.70 %	211'400.00	0.08
CH1341035025	1.75 % Berlin Hyp 24-28	100'000	CHF	101.60 %	101'600.00	0.04
CH1357852750	1.51 % Berlin Hyp 24-30 NT	100'000	CHF	100.70 %	100'700.00	0.04
CH1357852800	2 % Vonovia 24-31	100'000	CHF	100.75 %	100'750.00	0.04
Allemagne					7'058'000.00	2.79

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	20

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0026985520	2 7/8 % Kommunekredit 06-31 NT	200'000	CHF	113.80 %	227'600.00	0.09
CH0285597370	5/8 % Kommunekredit 15-27 NT	300'000	CHF	99.40 %	298'200.00	0.12
Danemark					525'800.00	0.21
CH0505011947	0.20 % Banco Santander 19-27	200'000	CHF	97.00 %	194'000.00	0.08
CH0506071148	0.775 % Cellnex Telecom 20-27 NT	100'000	CHF	98.25 %	98'250.00	0.04
CH0522690707	1/8 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 20-26 NT	200'000	CHF	97.65 %	195'300.00	0.08
CH1112011593	0.477 % CAIXABANK 21-27 Tranche 1 NT	400'000	CHF	97.90 %	391'600.00	0.15
CH1227937724	2.2475 % Banco Santander 23-26 Series 176 NT	100'000	CHF	101.50 %	101'500.00	0.04
CH1290871008	2.395 % Banco Santander 24-29 NT	100'000	CHF	103.05 %	103'050.00	0.04
CH1290871016	2.24 % Banco Santander 24-32	200'000	CHF	105.25 %	210'500.00	0.08
CH1357852685	1.5625 % Iberdrola Finanzas S.A.U 24-31	100'000	CHF	101.05 %	101'050.00	0.04
CH1359203382	2.345 % Banco Santander 24-31 NT	100'000	CHF	103.55 %	103'550.00	0.04
Espagne					1'498'800.00	0.59
CH0545766534	1/8 % Nordea Bank 20-26 NT	400'000	CHF	98.30 %	393'200.00	0.16
CH1244321779	1 5/8 % Municipality Finance 23-28 NT	200'000	CHF	102.85 %	205'700.00	0.08
CH1244321803	1 1/2 % Nordic Investment Bank 23-28 NT	200'000	CHF	102.65 %	205'300.00	0.08
CH1335850280	1.1525 % Nordic Investment Bank 24-31 NT	50'000	CHF	102.50 %	51'250.00	0.02
Finlande					855'450.00	0.34
CH0024141100	2 1/2 % CFF 06-31 NT	200'000	CHF	108.85 %	217'700.00	0.09
CH0124739902	2 1/2 % CADES 11-25	200'000	CHF	101.65 %	203'300.00	0.08
CH0124855328	2 5/8 % SNCF Reseau 11-31 NT	200'000	CHF	109.60 %	219'200.00	0.09
CH0125067774	2 5/8 % SNCF Reseau 11-37 NT	200'000	CHF	116.25 %	232'500.00	0.09
CH0255893072	1/2 % Credit Agricole Home Loan 15-27 NT	400'000	CHF	98.75 %	395'000.00	0.16
CH0379610972	0.60 % BFCM 17-27 NT	200'000	CHF	98.45 %	196'900.00	0.08
CH0457206784	0.45 % Credit Agricole Home Loan 19-29	400'000	CHF	97.60 %	390'400.00	0.15
CH0483180953	0.20 % ORANGE 19-25 NT	500'000	CHF	98.94 %	494'700.00	0.23
CH0506071205	0.15 % BNP Paribas 20-28 NT	400'000	CHF	95.60 %	382'400.00	0.15
CH0517825292	0.20 % Banque Federative du Credit Mutuel 20-28 NT	200'000	CHF	95.60 %	191'200.00	0.08
CH0521617339	1/4 % Societe Generale 20-27 NT	400'000	CHF	96.85 %	387'400.00	0.15
CH1118460984	0.2125 % Credit Agricole 21-29 NT	200'000	CHF	95.00 %	190'000.00	0.08
CH1125186663	0.1475 % BNP Paribas 21-27 NT	200'000	CHF	97.05 %	194'100.00	0.08
CH1159841340	0.745 % Societe Generale 22-29 NT	400'000	CHF	96.15 %	384'600.00	0.15
CH1179184416	0.89 % Compagnie de Financement Foncier 22-29	200'000	CHF	99.40 %	198'800.00	0.08
CH1231312690	2.19 % Credit Agricole 22-27	400'000	CHF	103.05 %	412'200.00	0.16
CH1242969199	2.30 % Banque Federative du Credit Mutuel 23-27 NT	200'000	CHF	102.65 %	205'300.00	0.08
CH1244321761	2.63 % BNP Paribas 23-29 NT	200'000	CHF	105.65 %	211'300.00	0.08
CH1249151049	1 3/4 % Caisse des Depots et Consignations 23-31 NT	200'000	CHF	104.35 %	208'700.00	0.08
CH1249416004	2.5413 % Credit Agricole 23-30	200'000	CHF	106.55 %	213'100.00	0.08
CH1251030107	1.903 % Compagnie de Financement Foncier 23-28	200'000	CHF	103.00 %	206'000.00	0.08
CH1271360567	1 5/8 % Credit Agricole next bank (Suisse) 22-29	200'000	CHF	104.15 %	208'300.00	0.08
CH1276269730	2.73 % Banque Federative du Credit Mutuel 23-30 NT	200'000	CHF	107.40 %	214'800.00	0.08
CH1277582008	2.34 % ENGIE 23-27 NT	200'000	CHF	102.35 %	204'700.00	0.08
CH1277582016	2.49 % ENGIE 23-31 NT	200'000	CHF	106.30 %	212'600.00	0.08

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH1279261148	1.8375 % CFF 23-30 NT	200'000	CHF	104.60 %	209'200.00	0.08
CH1290870976	2.1225 % BNP Paribas 24-32	400'000	CHF	103.50 %	414'000.00	0.16
CH1290870992	1.5825 % SNCF 24-39 NT	100'000	CHF	104.70 %	104'700.00	0.04
CH1290871024	1.5125 % RATP 24-36 NT	200'000	CHF	103.50 %	207'000.00	0.08
CH1294486357	2.3625 % Credit Agricole 23-28 NT	400'000	CHF	104.35 %	417'400.00	0.16
CH1298957064	2.6825 % Societe Generale 23-29 NT	200'000	CHF	106.20 %	212'400.00	0.08
CH1321113453	2.2225 % Banque Federative du Credit Mutuel 24-32 NT	200'000	CHF	104.80 %	209'600.00	0.08
CH1335850298	1.4778 % Agence France Locale (AFL) 24-34 NT	200'000	CHF	102.80 %	205'600.00	0.08
France					8'555'100.00	3.38
CH0337829268	1/2 % Vodafone Group 16-31	200'000	CHF	95.00 %	190'000.00	0.08
CH0357520466	5/8 % Vodafone Group 17-27 NT	200'000	CHF	98.95 %	197'900.00	0.08
CH0485445990	0.1675 % Nationwide Building Society 19-31	200'000	CHF	94.05 %	188'100.00	0.07
CH0550413394	1/2 % Credit Agricole London Branch 20-26 NT	200'000	CHF	98.05 %	196'100.00	0.08
CH1154887157	0.6025 % Lloyds Banking Group 22-29 NT	200'000	CHF	96.45 %	192'900.00	0.08
CH1199322384	0.9194 % Nationwide Building Society 22-25 Tranche 1	300'000	CHF	99.87 %	299'610.00	0.12
CH1236363417	2.0125 % Nationwide Building Society 23-30	200'000	CHF	105.20 %	210'400.00	0.08
CH1243018806	2.745 % Lloyds Banking Group 23-27 NT	400'000	CHF	101.75 %	407'000.00	0.16
CH1270825545	2.8575 % NatWest Markets 23-28	400'000	CHF	105.45 %	421'800.00	0.17
CH1280994299	2.97 % Nationwide Building Society 23-27	600'000	CHF	102.80 %	616'800.00	0.24
CH1292012783	2.005 % Santander UK 23-29 Series 83	250'000	CHF	104.70 %	261'750.00	0.10
Grande-Bretagne					3'182'360.00	1.26
CH1135555576	0.17 % CABEI 21-31 NT	400'000	CHF	90.25 %	361'000.00	0.14
CH1148308716	0.11 % CABEI 21-28 NT	300'000	CHF	94.50 %	283'500.00	0.11
Honduras					644'500.00	0.25
CH1243933582	1.8925 % Korea Housing Finance 23-28 Tranche 2	300'000	CHF	102.55 %	307'650.00	0.12
CH1271360641	2.0275 % Korea Railroad 23-25	300'000	CHF	101.13 %	303'390.00	0.12
CH1279261155	2.2225 % The Korea Development Bank 23-26 NT	300'000	CHF	102.20 %	306'600.00	0.12
CH1314941407	1.778 % Korea Housing Finance 24-27	200'000	CHF	101.60 %	203'200.00	0.08
Corée du Sud					1'120'840.00	0.44
CH0338330431	0.20 % LGT Bank 16-26	200'000	CHF	98.20 %	196'400.00	0.08
CH0536893255	0.30 % Liechtensteinische Landesbank 20-30	200'000	CHF	92.65 %	185'300.00	0.07
CH1212189158	2 3/4 % LGT Bank 22-32	200'000	CHF	110.35 %	220'700.00	0.09
CH1306117040	2 1/2 % Liechtensteinische Landesbank 23-30 NT	200'000	CHF	105.75 %	211'500.00	0.08
CH1323274055	2 % LGT Bank 24-34 NT	200'000	CHF	105.35 %	210'700.00	0.08
Liechtenstein					1'024'600.00	0.40
CH0119542634	2 % BEI 10-35	400'000	CHF	112.55 %	450'200.00	0.18
CH0204975426	1 3/8 % EIB 13-28	200'000	CHF	102.15 %	204'300.00	0.08
CH0215376325	1 3/4 % EIB 13-33	100'000	CHF	108.25 %	108'250.00	0.04
CH0401956872	0.956 % Grand City Properties 18-26 NT	200'000	CHF	98.90 %	197'800.00	0.08
CH1356197108	2.15 % TRATON Finance Luxembourg 24-27 NT	100'000	CHF	101.55 %	101'550.00	0.04
Luxembourg					1'062'100.00	0.42

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	22

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0026233491	3 1/4 % NWB 06-29 NT	400'000	CHF	111.35 %	445'400.00	0.20
CH0118668257	2 1/8 % BNG Bank 10-29	200'000	CHF	106.30 %	212'600.00	0.08
CH0465044631	3/4 % BMW Intl 19-27 NT Tranche 2	200'000	CHF	98.85 %	197'700.00	0.08
CH1121837244	0.55 % Digital Intrepid Holding 21-29 NT	200'000	CHF	94.45 %	188'900.00	0.07
CH1174335724	0.235 % Nederlandse Waterschapsbank 22-27 NT	200'000	CHF	98.35 %	196'700.00	0.08
CH1206367604	2.10 % Würth Finance International 22-26	200'000	CHF	102.10 %	204'200.00	0.08
CH1236363425	2.4875 % Cooperatieve Rabobank U.A. 23-29 NT	200'000	CHF	103.20 %	206'400.00	0.08
CH1264414348	2.13 % Toyota Motor Finance 23-27	200'000	CHF	102.85 %	205'700.00	0.08
CH1296276152	2.47 % Achmea Bank 23-26 NT	400'000	CHF	102.55 %	410'200.00	0.16
CH1300224875	1.96 % MercedesBenz International Finance 23-26	200'000	CHF	101.80 %	203'600.00	0.08
CH1300224883	2.1075 % MercedesBenz International Finance 23-29 NT	100'000	CHF	104.50 %	104'500.00	0.04
CH1300950008	2.01 % Toyota Motor Finance (Netherlands) 23-26	200'000	CHF	101.90 %	203'800.00	0.08
CH1300950016	2.12 % Toyota Motor Finance 23-29 NT	200'000	CHF	104.60 %	209'200.00	0.08
CH1321508355	1.83 % Toyota 24-28 NT	250'000	CHF	102.60 %	256'500.00	0.10
CH1323274097	1.2375 % BNG Bank 24-29	300'000	CHF	101.55 %	304'650.00	0.12
CH1353257749	1.3175 % BNG Bank 24-39	200'000	CHF	105.50 %	211'000.00	0.08
Pays-Bas					3'761'050.00	1.49
CH0116403517	2 % DNB Boligkredit 10-30 NT	200'000	CHF	105.15 %	210'300.00	0.08
CH1174335765	0.5075 % Sparebank 1 Boligkredit 22-27	300'000	CHF	98.75 %	296'250.00	0.12
CH1174335815	0.545 % Kommunalbanken 22-28	300'000	CHF	98.55 %	295'650.00	0.12
CH1249416012	2.70 % SpareBank 1 Nord-Norge 23-29 NT	200'000	CHF	103.90 %	207'800.00	0.08
CH1271360583	1.81 % Kommunalbanken 23-30 NT	200'000	CHF	104.90 %	209'800.00	0.08
CH1273429691	2.685 % DNB Bank 23-28 NT	400'000	CHF	102.45 %	409'800.00	0.16
CH1357852826	1.3075 % SpareBank 1 Nord-Norge 24-30 NT	100'000	CHF	99.90 %	99'900.00	0.04
Norvège					1'729'500.00	0.68
CH1221150464	2.005 % Auckland Council 22-32 NT	200'000	CHF	107.65 %	215'300.00	0.09
Nouvelle-Zélande					215'300.00	0.09
CH0109156262	2 3/4 % Asian Development Bank 10-30	200'000	CHF	110.60 %	221'200.00	0.09
Philippines					221'200.00	0.09
CH1344316695	1.5225 % Slovakia 24-28 NT	100'000	CHF	101.40 %	101'400.00	0.04
CH1344316703	1.915 % Slovakia 24-34 NT	100'000	CHF	103.65 %	103'650.00	0.04
Slovaquie					205'050.00	0.08
CH0301549348	1/4 % Akademiska Hus 15-25	300'000	CHF	99.07 %	297'210.00	0.12
CH1184694748	0.78 % Akademiska Hus 22-28 NT	200'000	CHF	99.20 %	198'400.00	0.08
CH1239494979	1.7125 % Aktiebolaget Svensk Exportkredit 23-30	200'000	CHF	104.00 %	208'000.00	0.08
CH1249416020	1.9925 % Akademiska Hus 23-33 NT	200'000	CHF	107.90 %	215'800.00	0.09
CH1271360401	2.7725 % Swedbank 23-28 NT	200'000	CHF	105.00 %	210'000.00	0.08
Suède					1'129'410.00	0.45
CH0260769440	1 7/8 % AT&T 14-30	200'000	CHF	104.65 %	209'300.00	0.08
CH0362748276	0.20 % North American Development Bank 17-27	200'000	CHF	97.50 %	195'000.00	0.08
CH0383104335	1/4 % Nestle 17-27	200'000	CHF	97.85 %	195'700.00	0.08

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	23

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CH0423233540	0.30 % North American Development Bank 18-26	300'000	CHF	98.65 %	295'950.00	0.12
CH0471297959	1/4 % New York Life Global Funding 19-27 NT Unitary 144A	200'000	CHF	97.40 %	194'800.00	0.08
CH0482172340	1/8 % Metropolitan Life Global Funding 19-27 NT Reg S	400'000	CHF	97.30 %	389'200.00	0.15
CH0517825268	1/8 % Jackson National Life Global Funding 20-28 Unitary 144	300'000	CHF	94.35 %	283'050.00	0.11
CH0564642095	1/8 % New York Life Global Funding 20-29 NT	200'000	CHF	95.05 %	190'100.00	0.08
CH0581947790	1/2 % Athene Global Funding 21-27 NT	200'000	CHF	97.25 %	194'500.00	0.08
CH1105672658	0.1925 % Verizon Communications 21-28	300'000	CHF	96.35 %	289'050.00	0.11
CH1105672682	1/8 % New York Life Global Funding NT 21-30	250'000	CHF	94.10 %	235'250.00	0.09
CH1137122839	1/4 % Pacific Life Global Funding II 21-28 NT	200'000	CHF	95.75 %	191'500.00	0.08
CH1179534982	1 3/8 % New York Life Global Funding 22-28 NT	300'000	CHF	100.95 %	302'850.00	0.12
CH1179534990	1 3/4 % Pacific Life Global Funding II 22-29 NT	200'000	CHF	101.75 %	203'500.00	0.08
CH1199659934	2.15 % Metropolitan Life Global Funding 22-26 Reg S	200'000	CHF	102.35 %	204'700.00	0.08
CH1255924461	2.65 % Massmutual Global Funding II 23-28 Series 2023-4	200'000	CHF	105.00 %	210'000.00	0.08
CH1271360625	2 7/8 % Equinix 23-28	200'000	CHF	105.15 %	210'300.00	0.08
CH1290871040	1 7/8 % Metropolitan Life Global Funding I 24-31 NT	400'000	CHF	103.40 %	413'600.00	0.16
CH1341035041	1 7/8 % New York Life Global Funding 24-32 NT	150'000	CHF	104.35 %	156'525.00	0.06
Etats-Unis					4'564'875.00	1.80

CH1151526238	0.45 % Andean Development Corporation 22-27 NT	500'000	CHF	97.75 %	488'750.00	0.19
CH1210198128	2.08 % Corporacion Andina De Fomento 22-28	300'000	CHF	102.50 %	307'500.00	0.12
Vénézuéla					796'250.00	0.31

Valeurs mobilières non cotées en bourse

Obligations					886'022.00	0.35
--------------------	--	--	--	--	-------------------	-------------

CH1371736831	1.4875 % Federation Des Caisses Desjardins Du Quebec 24-29	100'000	CHF	99.841 %	99'841.00	0.04
Canada					99'841.00	0.04

CH1361401891	1.5606 % Burckhardt Compression Holding 24-28	75'000	CHF	100.256 %	75'192.00	0.03
CH1373904387	1.30 % kenova 24-34	100'000	CHF	99.958 %	99'958.00	0.04
CH1373904395	0.95 % Centrale d'Emission pour la const. de Logements 24-44	100'000	CHF	101.922 %	101'922.00	0.04
CH1373904403	1.60 % Galderma Holding 24-28	100'000	CHF	100.451 %	100'451.00	0.04
CH1373904429	1 1/2 % Universitaetsspital Zurich 24-32	100'000	CHF	100.116 %	100'116.00	0.04
CH1377443804	1.65 % Zug Estates Holding 24-31	100'000	CHF	99.642 %	99'642.00	0.04
Suisse					577'281.00	0.23

CH1321481538	2 1/2 % Muenchener Hypothekenbank 24-30	200'000	CHF	104.45 %	208'900.00	0.08
Allemagne					208'900.00	0.08

Inventaire résumé	Valeur vénale	en %
Avoirs en banque à vue	397'210.80	0.16
Obligations, obligations convertibles, emprunts à option et autres titres de créance et droits-valeurs	251'221'783.49	99.23
Autres actifs	1'551'453.76	0.61
Fortune totale du fonds à la fin de la période comptable	253'170'448.05	100.00
Autres engagements	-350'034.25	
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	252'820'413.80	

Risques sur instruments financiers dérivés selon l'approche Commitment II

Engagement du fonds	% de la fortune nette	Montant
Engagement total brut résultant de dérivés	0%	0.0
Engagement total net résultant de dérivés	0%	0.00
Engagement de prêts de valeurs mobilières et d'opérations de pension	0%	0.00
Informations supplémentaires et opérations hors-bilan		
Valeurs mobilières prêtées à la date du bilan		0.00
Valeurs mobilières mises en pension à la date du bilan		0.00
Montant du compte prévu pour être réinvesti		411'247.38
Type et montant des sûretés acceptées		
Aucune sûreté acceptée		0.00
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	2'400'000	0
CH0009755197	4 % Confederation Suisse 99-49	1'120'000	0
CH0015803239	3 1/2 % Confederation Suisse 03-33	2'120'000	0
CH0020469075	2 7/8 % Eurofima 05-30	400'000	0
CH0020632144	2 7/8 % OEKB 05-30	300'000	0
CH0022566175	2 1/2 % Stadt Bern 05-25	250'000	100'000
CH0024141100	2 1/2 % CFF 06-31 NT	200'000	0
CH0024484187	2.55 % Stadt Zuerich 06-36	300'000	0
CH0024524966	2 1/2 % Confederation Suisse 06-36	1'920'000	0
CH0025185676	3 % Eurofima 06-26	300'000	0
CH0026233491	3 1/4 % NWB 06-29 NT	400'000	0
CH0026985520	2 7/8 % Kommunekredit 06-31 NT	200'000	0
CH0029008809	2 3/4 % KFW 07-37	200'000	0
CH0031835561	3 1/4 % Confederation Suisse 07-27	1'380'000	0
CH0109156262	2 3/4 % Asian Development Bank 10-30	200'000	0
CH0116403517	2 % DNB Boligkredit 10-30 NT	200'000	0
CH0118095667	1 7/8 % Basler KB 10-26	150'000	0
CH0118668257	2 1/8 % BNG Bank 10-29	200'000	0
CH0119015086	2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 10-25 Series 405	1'500'000	500'000
CH0119542634	2 % BEI 10-35	400'000	0
CH0119983077	1 7/8 % Luzerner KB 10-35	250'000	0
CH0120736852	2 % Luzerner KB 10-39	300'000	0
CH0122512152	2 5/8 % Raiffeisen Suisse 11-26	400'000	0
CH0124138840	2 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 11-27 Series 544	1'100'000	0
CH0124739902	2 1/2 % CADES 11-25	200'000	0
CH0124855328	2 5/8 % SNCF Reseau 11-31 NT	200'000	0
CH0125067774	2 5/8 % SNCF Reseau 11-37 NT	200'000	0
CH0126519047	2 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 11-26 Series 552	2'400'000	700'000
CH0126875803	2 1/2 % Stadt Bern 11-41	300'000	0
CH0127181029	2 1/4 % Confederation Suisse 11-31	1'540'000	0
CH0127181169	1 1/2 % Confederation Suisse 12-42	1'840'000	0
CH0127181193	1 1/4 % Confederation Suisse 12-37	2'030'000	0
CH0130158642	2 1/2 % ZKB 11-31 Series 122	500'000	0
CH0130614883	2 3/8 % Kanton Luzern 11-27	300'000	100'000
CH0136611800	1 3/4 % Ctrle EM de Logements CCL 11-26 Serie 42	300'000	0
CH0137992803	2 % Graubuendner KB 11-41	150'000	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)
CH0147144361	1 1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 12-28 Series 562	1'400'000	0
CH0180428531	2 7/8 % KW Linth-Limmern 12-42	100'000	0
CH0181932952	1 1/4 % Cantone del Ticino 12-27	400'000	0
CH0184636915	1 3/5 % Aargauische KB 12-37	150'000	0
CH0184911961	1 1/2 % Canton de Geneve 12-27	400'000	0
CH0187043820	1 3/8 % St.Galler KB 12-27	300'000	0
CH0194958960	3 % KW Linth-Limmern 12-52	100'000	0
CH0200044789	2 3/8 % Nant de Drance 13-28	300'000	0
CH0204276213	1 1/2 % Ville de Winterthour 13-36	300'000	0
CH0204365651	1 1/4 % Kanton Bern 13-28	300'000	0
CH0204975426	1 3/8 % EIB 13-28	200'000	0
CH0205276725	1 1/2 % Kanton Bern 13-29	250'000	0
CH0206992270	1 1/2 % Thurgauer KB 13-27	100'000	0
CH0207413185	1 7/8 % Cantone del Ticino 13-38	300'000	0
CH0208271541	3 % KW Linth-Limmern 13-48	220'000	0
CH0208323458	1 3/4 % Canton de Geneve 13-33	300'000	0
CH0209002341	1 1/2 % Ville de Lausanne 13-28	200'000	0
CH0212459561	1 3/4 % Canton de Geneve 13-34	300'000	0
CH0214925874	1 1/2 % Kanton Baselland 13-28	400'000	0
CH0215376325	1 3/4 % EIB 13-33	100'000	0
CH0217850681	1 5/8 % Kanton Zuerich 13-26	400'000	0
CH0217850699	2 % Kanton Zuerich 13-38	300'000	0
CH0224396983	1 1/4 % Confederation Suisse 14-26	1'500'000	0
CH0224397007	2 % Confederation Suisse 14-64	1'450'000	0
CH0224397171	1/2 % Confederation Suisse 15-30	2'320'000	120'000
CH0224397338	1/2 % Confederation Suisse 16-58	1'570'000	0
CH0224397346	0 % Confederation Suisse 16-29	2'920'000	0
CH0224923513	1 3/4 % Schaffhauser KB 13-25	250'000	0
CH0237649964	2 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth 14-44 Series 589	480'000	0
CH0247776138	1 1/2 % Swisscom 14-26	550'000	0
CH0252903767	1 3/8 % Kanton Basel-Stadt 14-34	100'000	0
CH0255893072	1/2 % Credit Agricole Home Loan 15-27 NT	400'000	0
CH0260769440	1 7/8 % AT&T 14-30	200'000	0
CH0263432988	1 % Centr. LdG Bques Cant. CH 14-28 Series 459	3'200'000	0
CH0267222310	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-30 Series 604	1'800'000	0
CH0267855986	1/8 % Kanton Baselland 15-26	250'000	0
CH0267855994	5/8 % Kanton Baselland 15-36	250'000	0
CH0268988182	1 % Swisscom 15-35 Tranche 2	200'000	0
CH0270190991	5/8 % Novartis 15-29	300'000	0
CH0272154177	1 % Kanton Baselland 15-40	300'000	0
CH0274253514	0.60 % Banque Cantonale de Fribourg 15-27	250'000	0
CH0274314787	3/4 % Basellandschaftliche KB 15-28	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

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	27

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0275527882	5/8 % Aargauische KB 15-28	250'000	0
CH0278667115	1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-30 Series 464	2'600'000	0
CH0279135328	7/8 % SGS 15-30	200'000	0
CH0280569135	5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-34 Series 610	3'000'000	250'000
CH0282528907	1 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-45 Series 612	600'000	100'000
CH0284950505	1 1/8 % Stadt Zuerich 15-40	350'000	0
CH0285597370	5/8 % Kommunekredit 15-27 NT	300'000	0
CH0285849367	5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 15-27 Series 466	300'000	0
CH0301549348	1/4 % Akademiska Hus 15-25	300'000	0
CH0304755157	3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 15-34 Series 623	3'050'000	100'000
CH0306626224	2 % Nant de Drance 16-26	200'000	0
CH0310175564	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-26 Series 625	900'000	0
CH0310451858	1 1/4 % UBS Group Funding (Switzerland) 16-26 Tranche 2	400'000	0
CH0312512731	0.32 % Centrale d'Emission constr. Lgt CCL 16-36 Series 54	150'000	0
CH0319415938	3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-32 Series 628	2'300'000	0
CH0319415987	1/2 % Coop-Gruppe Genossenschaft 16-26	200'000	0
CH0319416134	1/2 % Stadt Bern 16-36	300'000	0
CH0319932767	0.40 % BCV 16-31	400'000	0
CH0326213920	0.60 % Canton de Geneve 16-46	400'000	0
CH0330143188	0.02 % ZKB 16-27 Series 139	200'000	0
CH0330938892	0 % Rhaetische Bahn 16-25	150'000	0
CH0331455334	0 % Kanton Basel-Stadt 16-26	300'000	0
CH0336352775	1/8 % Swisscom 16-32	300'000	0
CH0336587719	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-27 Series 483	2'100'000	0
CH0336587727	1/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 16-31 Series 484	3'600'000	0
CH0337645532	1/2 % Swiss Prime Site Finance 16-25	600'000	0
CH0337829268	1/2 % Vodafone Group 16-31	200'000	0
CH0338330415	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-32 Series 639	2'500'000	0
CH0338330431	0.20 % LGT Bank 16-26	200'000	0
CH0338330472	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 16-36 Series 641	900'000	0
CH0340912168	0.65 % Transurban Queensland Finance Pty 16-26 NT	200'000	0
CH0342587638	0.05 % ZKB 16-26 Series 140	150'000	0
CH0343366792	0.05 % Kanton Bern 16-31	400'000	0
CH0344583841	0.20 % Kanton Solothurn 16-28	300'000	0
CH0344958472	1/2 % Confederation Suisse 17-55	1'340'000	0
CH0344958498	1/2 % Confederation Suisse 17-45	2'170'000	0
CH0344958688	1/2 % Confederation Suisse 18-32	1'860'000	0
CH0347082783	1/4 % ZKB 17-26 Series 141	250'000	0
CH0347082809	0.30 % Banque Cantonale de Fribourg 17-27	150'000	0
CH0352595851	0.20 % Banque Cantonale du Valais 17-26	200'000	0
CH0352595927	0.55 % SGS 17-26	250'000	0
CH0353105197	3/8 % Thurgauer KB 17-28	250'000	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

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	28

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0357520466	5/8 % Vodafone Group 17-27 NT	200'000	0
CH0358654942	0.60 % Canton de Geneve 17-38	300'000	0
CH0359915409	0.45 % Roche Kapitalmarkt 17-29 Tranche 3	300'000	0
CH0361532879	5/8 % Flughafen Zuerich 17-29	300'000	0
CH0361532903	3/4 % Kantonsspital Aarau 17-32	200'000	0
CH0361533067	1/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 17-25 Series 496	4'800'000	1'850'000
CH0361533166	0.60 % Ctrle EM de Logements CCL 17-35 Series 57	150'000	0
CH0362748276	0.20 % North American Development Bank 17-27	200'000	0
CH0362748359	3/8 % Swisscom 17-27	200'000	0
CH0367206759	1/4 % Province of Ontario 17-29	200'000	0
CH0373476107	0.70 % Stadt Zuerich 17-39	150'000	0
CH0373476222	3/4 % Allreal Holding 17-26	575'000	0
CH0373476339	0.30 % ZKB 18-28 Series 142	250'000	0
CH0373476438	0.30 % Graubuedner KB 18-26	500'000	0
CH0373476636	1.05 % Georg Fischer 18-28	200'000	0
CH0373476784	1/2 % Schaffhauser KB 18-28	250'000	0
CH0373945093	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 17-27 Series 653	3'200'000	0
CH0379354225	1/4 % Aargauische KB 17-26	150'000	0
CH0379610972	0.60 % BFCM 17-27 NT	200'000	0
CH0383104335	1/4 % Nestle 17-27	200'000	0
CH0384629892	1 % dormakaba Finance 17-25	450'000	0
CH0385997108	0.45 % Deutsche Bahn Finance 17-30 NT	300'000	0
CH0387879049	1/2 % Canton de Geneve 17-31	400'000	0
CH0391491518	1/4 % BCV 17-25	500'000	0
CH0392885809	3/8 % Banca dello Stato del Cantone Ticino 18-28	300'000	0
CH0397450724	1/4 % Basellandschaftliche KB 18-27	100'000	0
CH0398633369	0.35 % Banque Cantonale de Neuchatel 18-26	150'000	0
CH0398633534	1 1/4 % SGS 18-28	400'000	0
CH0398633641	3/4 % Ctrle EM de Logements CCL 18-32 Series 60	450'000	0
CH0398633799	0.15 % ZKB 19-27 Series 144	300'000	0
CH0398633807	0.70 % PSP Swiss Property 19-27 Reg S	200'000	0
CH0398913498	0.20 % Banque Cantonale de Fribourg 18-26	150'000	0
CH0399611307	0.35 % Luzerner KB 18-27	100'000	0
CH0401956872	0.956 % Grand City Properties 18-26 NT	200'000	0
CH0405985836	0.70 % Thurgauer KB 18-30	250'000	0
CH0407153359	3/8 % Basellandschaftliche KB 18-26	200'000	0
CH0413618353	0.70 % Kantonsspital Baden 18-28	300'000	0
CH0419040727	0.20 % Banque Valiant 19-27	250'000	0
CH0419040735	0.30 % Banque Cantonale du Valais 19-27	200'000	0
CH0419040792	3/4 % Zurich Compagnie d'Assurances 19-27 NT	200'000	0
CH0419040891	1/2 % Kanton Basel-Stadt 19-34	350'000	0
CH0419040958	0.70 % Centr. LdG Bques Cant. CH 19-39 Series 510	2'200'000	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

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	29

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0419041063	0.60 % Geberit 19-28	400'000	0
CH0419041071	5/8 % Ville de Bienne 19-27	300'000	0
CH0419041139	3/8 % Banque Cler 19-27	200'000	0
CH0419041238	1/8 % ZKB 19-29 Series 145	400'000	0
CH0419041378	5/8 % Aarekraftwerk Klingnau 19-29	200'000	0
CH0419041535	0.01 % Banco Del Estado De Chile 19-27 NT	200'000	0
CH0419041659	0.1525 % Cembra Money Bank 19-26	300'000	0
CH0419041675	0 % Banque Valiant 19-25	100'000	0
CH0419042509	3/4 % Nestle 18-28	300'000	0
CH0423233524	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-29 Series 660	2'800'000	500'000
CH0423233540	0.30 % North American Development Bank 18-26	300'000	0
CH0423233557	1/2 % Deutsche Bahn Finance 18-28 NT	200'000	0
CH0433761316	3/4 % Roche Kapitalmarkt 18-30	200'000	0
CH0434678378	0 % Kanton Luzern 18-25	150'000	0
CH0434678402	1 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-48 Series 664	200'000	0
CH0438965581	1 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 18-47 Series 665	560'000	0
CH0440081393	0 % Confederation Suisse 19-34	1'600'000	0
CH0440081401	0 % Confederation Suisse 19-39	1'730'000	0
CH0440081567	1 1/2 % Confederation Suisse 22-38	800'000	0
CH0446595685	0.40 % BLS 18-28	250'000	0
CH0446595693	0.95 % BLS 18-39	150'000	0
CH0457206784	0.45 % Credit Agricole Home Loan 19-29	400'000	0
CH0458097950	1/4 % Westpac Banking 19-27	100'000	0
CH0459810534	1/8 % Aargauische KB 19-26	300'000	0
CH0460872341	1/4 % Muenchener Hypothekenbank 19-29	200'000	0
CH0461238864	3/8 % Stadler Rail 19-26	200'000	0
CH0461238948	1 5/8 % Hypo Vorarlberg Bank 19-29 NT	200'000	0
CH0461239003	1/8 % Province of New Brunswick 19-32	200'000	0
CH0461239011	1/4 % Province of New Brunswick 19-39	200'000	0
CH0461239029	1/8 % Banque Valiant 19-34	250'000	0
CH0461239045	0.05 % ZKB 20-31 Series 146	400'000	0
CH0461239086	0.05 % Basellandschaftliche KB 20-31	250'000	0
CH0461239102	0 % Swissgrid 20-28	400'000	0
CH0461239110	0.20 % Swissgrid 20-32	100'000	0
CH0465044631	3/4 % BMW Intl 19-27 NT Tranche 2	200'000	0
CH0465044649	0.10 % Stadt Winterthur 19-28	300'000	0
CH0471297959	1/4 % New York Life Global Funding 19-27 NT Unitary 144A	200'000	0
CH0474977730	0.80 % Grande Dixence 19-26	200'000	0
CH0481013768	0.20 % Muenchener Hypothekenbank 19-31	200'000	0
CH0482172340	1/8 % Metropolitan Life Global Funding 19-27 NT Reg S	400'000	0
CH0482172399	1/2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-41 Series 674	640'000	0
CH0483180953	0.20 % ORANGE 19-25 NT	500'000	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

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	30

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0485252875	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-49 Series 678	400'000	0
CH0485260902	0.10 % Banque Cantonale de Fribourg 19-44	300'000	0
CH0485261579	3/8 % Canton de Geneve 20-30	250'000	0
CH0485261603	0.35 % Ctrle EM de Logements CCL 20-40 Series 63	150'000	0
CH0485445990	0.1675 % Nationwide Building Society 19-31	200'000	0
CH0488506681	3/8 % Swiss Prime Site Finance 19-31	200'000	0
CH0494734376	1/4 % Banco de Credito e Inversiones 19-29	100'000	0
CH0498589032	0.10 % Canton de Neuchatel 19-49	150'000	0
CH0502393355	0 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 19-26 Series 680	300'000	0
CH0505011913	0 % Canton de Geneve 19-28	300'000	0
CH0505011939	0.30 % Canton de Geneve 19-39	400'000	0
CH0505011947	0.20 % Banco Santander 19-27	200'000	0
CH0506071106	0.01 % Aargauische KB 20-30	300'000	0
CH0506071130	0 % Luzerner KB 20-28	300'000	0
CH0506071148	0.775 % Cellnex Telecom 20-27 NT	100'000	0
CH0506071171	0.02 % Centr. LdG Bques Cant. CH 20-40 Series 518	1'100'000	0
CH0506071205	0.15 % BNP Paribas 20-28 NT	400'000	0
CH0506071213	1/4 % Mobimo Holding 20-28	200'000	0
CH0506071239	0.10 % Banco de Credito e Inversiones 20-26	200'000	0
CH0506071270	0.14 % Banque Cantonale de Fribourg 20-30	400'000	0
CH0506071296	0 % Kanton Luzern 20-30	200'000	0
CH0506071338	1/8 % Luzerner KB 20-32	400'000	0
CH0506071361	0.20 % PSP Swiss Property 21-31	200'000	0
CH0506071395	1/4 % Basler KB 21-36	150'000	0
CH0512502995	0.113 % Commonwealth Bank of Australia 19-29 NT	250'000	0
CH0515152467	0.13 % Swisscom 20-31	200'000	0
CH0517825268	1/8 % Jackson National Life Global Funding 20-28 Unitary 144	300'000	0
CH0517825292	0.20 % Banque Federative du Credit Mutuel 20-28 NT	200'000	0
CH0520042513	1/2 % Bobst Group 20-26	300'000	0
CH0520663672	0.20 % Flughafen Zuerich 20-35	200'000	0
CH0521333655	0.435 % Deutsche Telekom 20-32 NT	200'000	0
CH0521617297	0 % Banque Cantonale du Valais 20-29	250'000	0
CH0521617339	1/4 % Societe Generale 20-27 NT	400'000	0
CH0522158846	1/4 % St Galler KB 21-35	150'000	0
CH0522158861	0.40 % BCV 21-36	200'000	0
CH0522158887	0.20 % Deutsche Bahn Finance 21-33 NT	200'000	0
CH0522158895	0 % Kanton Luzern 21-31	400'000	0
CH0522158903	0.10 % Banque Valiant 21-30	150'000	0
CH0522159034	1.70 % Basellandschaftliche KB 22-42	100'000	0
CH0522690707	1/8 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 20-26 NT	200'000	0
CH0525158371	0.10 % Zurich Compagnie d'Assurances 20-32 NT	200'000	0
CH0528881227	1/4 % Alberta 20-28 NT	100'000	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

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	31

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH0536892588	0.95 % SGS 20-26	300'000	0
CH0536892737	0 % Kanton Zuerich 20-28	300'000	0
CH0536893255	0.30 % Liechtensteinische Landesbank 20-30	200'000	0
CH0536893511	0.10 % Centrale d'Emission constr. Lgt CCL 20-38 Series 64	150'000	0
CH0537261866	0.70 % Province of Manitoba 20-40 NT	200'000	0
CH0545754688	1/8 % Basler KB 20-32	300'000	0
CH0545766534	1/8 % Nordea Bank 20-26 NT	400'000	0
CH0547243235	0.05 % Canton de Geneve 20-29	300'000	0
CH0547243276	3/4 % Sonova Holding 20-28	100'000	0
CH0550413394	1/2 % Credit Agricole London Branch 20-26 NT	200'000	0
CH0557778310	1/4 % Confederation Suisse 21-35	1'630'000	0
CH0557778815	1 1/4 % Confederation Suisse 23-43	1'340'000	0
CH0557779003	7/8 % Confederation Suisse 24-47	510'000	0
CH0561923845	0.80 % Sulzer 20-25	600'000	0
CH0564642053	0.07 % Credit Agricole next bank (Suisse) 20-29	100'000	0
CH0564642061	0.35 % Lonza Swiss Finanz 20-26	200'000	0
CH0564642087	1/4 % Lindt & Spruengli 20-32	100'000	0
CH0564642095	1/8 % New York Life Global Funding 20-29 NT	200'000	0
CH0565650832	1/4 % Basellandschaftliche KB 20-32	350'000	0
CH0570576113	7/8 % Nant de Drance 20-29	200'000	0
CH0572327002	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-33 Series 694	3'700'000	1'000'000
CH0572899257	1/2 % Raiffeisen Suisse 20-28	200'000	0
CH0581947790	1/2 % Athene Global Funding 21-27 NT	200'000	0
CH0589030946	0 % ZKB 21-33 Series 149	300'000	0
CH0591084253	0.57 % Raiffeisen Suisse 21-31 Series 2	300'000	0
CH0593893917	1/8 % Hypo Vorarlberg Bank 21-28	200'000	0
CH0593893925	0.068 % First Abu Dhabi Bank 21-27 NT	200'000	0
CH0593894006	1/4 % Muenchener Hypothekenbank 21-27 NT	200'000	0
CH0598928742	1/4 % Berlin Hyp 21-31	400'000	0
CH1100259774	1/8 % Credit Agricole next bank (Suisse) 21-31	350'000	0
CH1100259790	0 % Cantone del Ticino 21-26	250'000	0
CH1100259808	1/4 % Muenchener Hypothekenbank 21-41	100'000	0
CH1101096522	0 % Centr. LdG Bques Cant. CH 21-28 Series 534	2'800'000	0
CH1101096621	0 % Kanton Zuerich 21-33	200'000	0
CH1101561525	1/4 % Holcim Helvetia Finance 21-27 NT	300'000	0
CH1105672658	0.1925 % Verizon Communications 21-28	300'000	0
CH1105672682	1/8 % New York Life Global Funding NT 21-30	250'000	0
CH1108704839	7/8 % Transurban Queensland Finance Pty 21-31 NT	200'000	0
CH1111392853	0 % Kanton Bern 21-33	400'000	0
CH1111392861	0.10 % Banque Cantonale du Valais 21-31	300'000	0
CH1112011510	0.05 % Province of Ontario 21-33	350'000	0
CH1112011569	0 % Stadt Zuerich 21-30	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

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	32

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH1112011593	0.477 % CAIXABANK 21-27 Tranche 1 NT	400'000	0
CH1112011601	0.33 % Banco Santander Chile 21-27 NT	200'000	0
CH1112246744	7/8 % Luzerner KB 21-31	200'000	0
CH1117896477	0.03 % Province of Quebec 21-31 NT	350'000	0
CH1118223408	0.15 % Stiftung Kantonsspital Graubuenden 21-30	200'000	0
CH1118223499	0.30 % Kantonsspital St. Gallen 21-36	200'000	0
CH1118460984	0.2125 % Credit Agricole 21-29 NT	200'000	0
CH1120085696	0.385 % Banco de Credito e Inversiones 21-26 NT	200'000	0
CH1121837244	0.55 % Digital Intrepid Holding 21-29 NT	200'000	0
CH1125186663	0.1475 % BNP Paribas 21-27 NT	200'000	0
CH1127263965	0.05 % Canton de Geneve 21-41	250'000	0
CH1127263973	1/8 % Holcim Helvetia Finance 21-27 NT	300'000	0
CH1130818839	1/8 % Baloise-Holding 21-30	400'000	0
CH1131931276	0 % Kantonsspital Winterthur 21-25	200'000	0
CH1131931284	0.35 % Kantonsspital Baden 21-36	200'000	0
CH1131931300	1/4 % Allgemeine Baugenossenschaft Zuerich 21-31	200'000	0
CH1131931326	0.10 % Primeo Holding 21-29	200'000	0
CH1132966297	0.03 % Credit Agricole next bank (Suisse) 21-31	200'000	0
CH1132966354	1/8 % Inselspital-Stiftung 21-29	200'000	0
CH1135555576	0.17 % CABEI 21-31 NT	400'000	0
CH1137122839	1/4 % Pacific Life Global Funding II 21-28 NT	200'000	0
CH1141700414	0.4175 % Cembra Money Bank 21-28	300'000	0
CH1141700547	0.20 % UBP 21-26	200'000	0
CH1142754287	0.795 % FONPLATA 21-28	200'000	0
CH1145096165	0.435 % UBS Group 21-28	400'000	0
CH1145096181	0.1475 % First Abu Dhabi Bank 21-26 NT	200'000	0
CH1146382481	3/8 % Emmi Finanz 21-31	100'000	0
CH1148266245	0.30 % Banque Cantonale du Valais 22-30	250'000	0
CH1148308716	0.11 % CABEI 21-28 NT	300'000	0
CH1148728210	0.30 % Baloise-Holding 22-27	300'000	0
CH1151526154	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 21-31 Series 710	2'500'000	0
CH1151526238	0.45 % Andean Development Corporation 22-27 NT	500'000	0
CH1154887157	0.6025 % Lloyds Banking Group 22-29 NT	200'000	0
CH1159841340	0.745 % Societe Generale 22-29 NT	400'000	0
CH1160188319	0.2925 % National Australia Bank 22-28 NT	200'000	0
CH1160382987	5/8 % Kanton Bern 22-35	300'000	0
CH1160680166	0.40 % Muenchener Hypothekenbank 22-26	400'000	0
CH1163572931	0.525 % Province of Saskatchewan 22-32	200'000	0
CH1164800661	0.45 % Usines Electriques de l'Engadine 22-29	200'000	0
CH1166151899	1/2 % Roche Kapitalmarkt 22-27	400'000	0
CH1166151907	3/4 % Roche Kapitalmarkt 22-31	300'000	0
CH1166151923	1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-27 Series 714	300'000	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

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	33

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH1166151972	1/2 % Hypo Vorarlberg Bank 22-27	300'000	0
CH1170565720	1.30 % Banque Cantonale de Neuchatel 22-32	250'000	0
CH1170565761	1.55 % Bell Food Group 22-29	300'000	0
CH1170565795	1.10 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-28 Series 550	1'600'000	0
CH1172972825	1.77 % HIAG Immobilien Holding 22-26	200'000	0
CH1174335724	0.235 % Nederlandse Waterschapsbank 22-27 NT	200'000	0
CH1174335765	0.5075 % Sparebank 1 Boligkreditt 22-27	300'000	0
CH1174335815	0.545 % Kommunalbanken 22-28	300'000	0
CH1175016091	3/8 % Muenchener Hypothekenbank 22-26	300'000	0
CH1179184416	0.89 % Compagnie de Financement Foncier 22-29	200'000	0
CH1179534941	1.40 % Sonova Holding 22-32	200'000	0
CH1179534982	1 3/8 % New York Life Global Funding 22-28 NT	300'000	0
CH1179534990	1 3/4 % Pacific Life Global Funding II 22-29 NT	200'000	0
CH1179535021	1 5/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-38 Series 719	1'200'000	0
CH1184694748	0.78 % Akademiska Hus 22-28 NT	200'000	0
CH1189217719	1.30 % % Graubuendner KB 22-30	250'000	0
CH1189217768	1.70 % Kantonsspital Baselland 22-32	200'000	0
CH1189217859	1.90 % Ville de Berne 22-53	200'000	0
CH1189217867	2.10 % Daetwyler Holding 22-27	200'000	0
CH1193213076	1 3/4 % Basler KB 22-29 Series 1	400'000	0
CH1194000324	1.45 % Helvetia Compagnie Suisse d'Assurances 22-26 Tr 1	600'000	0
CH1194355074	2 1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 22-52 Series 723	420'000	0
CH1194355108	1 5/8 % Nestle 22-26	300'000	0
CH1194355124	2 1/2 % Nestle 22-34	500'000	0
CH1195555409	1 1/4 % Muenchener Hypothekenbank 22-27	200'000	0
CH1199322384	0.9194 % Nationwide Building Society 22-25 Tranche 1	400'000	100'000
CH1199659934	2.15 % Metropolitan Life Global Funding 22-26 Reg S	200'000	0
CH1199659942	1 7/8 % Rhaetische Bahn 22-34	100'000	0
CH1204175140	1.24 % Commonwealth Bank of Australia 22-29	100'000	0
CH1204259811	1.95 % Deutsche Bahn Finance 22-32 NT	300'000	0
CH1206367471	2.55 % Groupe E 22-32	300'000	0
CH1206367521	2.10 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-30 Series 561	2'500'000	0
CH1206367570	1 5/8 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-26 Series 563	600'000	0
CH1206367596	2.35 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-37 Series 565	2'450'000	0
CH1206367604	2.10 % Wurth Finance International 22-26	200'000	0
CH1206367661	2.20 % Baloise-Holding 22-29	150'000	0
CH1206367679	1.45 % Kanton Zuerich 22-29	200'000	0
CH1210198128	2.08 % Corporacion Andina De Fomento 22-28	300'000	0
CH1211713214	2.0375 % TPG 22-34	150'000	0
CH1211713230	2 % Roche Kapitalmarkt 22-32	300'000	0
CH1212189158	2 3/4 % LGT Bank 22-32	200'000	0
CH1212189166	1.48 % Westpac Banking 22-26	400'000	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

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	34

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH1214797131	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 33-34 Series 728	2'300'000	0
CH1214797198	2 3/8 % ABB 22-30	400'000	0
CH1214797206	2.3775 % Adecco Group 22-27 NT	200'000	0
CH1216740667	2 1/8 % Basellandschaftliche KB 22-52	100'000	0
CH1217066583	1 7/8 % Basler KB 23-29	250'000	0
CH1217066591	2 % Basler KB 23-34	100'000	0
CH1221150464	2.005 % Auckland Council 22-32 NT	200'000	0
CH1221150480	1.9575 % Banque Nationale du Canada 22-27	100'000	0
CH1226543879	2.35 % Sika 22-28	300'000	0
CH1227937708	2.5025 % E.ON 22-29 NT	200'000	0
CH1227937724	2.2475 % Banco Santander 23-26 Series 176 NT	200'000	100'000
CH1228838129	2.285 % Deutsche Bahn Finance 22-42 NT	100'000	0
CH1230759503	1.95 % Sonova Holding 22-30	200'000	0
CH1230759560	1.95 % Inselspital-Stiftung 23-26	300'000	0
CH1231094355	2 1/8 % Luzerner KB 23-32	200'000	0
CH1231094363	1.96 % BAWAG P.S.K. Versicherung 23-31	200'000	0
CH1231094371	1.70 % Stadt Bern 23-33	100'000	0
CH1231094389	1.90 % Luzerner KB 23-31	300'000	0
CH1231094397	2 % Luzerner KB 23-38	250'000	0
CH1231312690	2.19 % Credit Agricole 22-27	400'000	0
CH1232107032	1.70 % Centr. LdG Bques Cant. CH 22-30 Series 567	100'000	0
CH1232107057	2 % VAUDOISE ASSURANCES HOLDING 22-27	100'000	0
CH1232107073	1.55 % Rhaetische Bahn 22-38	100'000	0
CH1232107172	1 5/8 % Stadt Lugano 23-29	300'000	0
CH1233900005	1 7/8 % Muenchener Hypothekenbank 23-30	200'000	0
CH1233900013	2 3/8 % Hypo Vorarlberg Bank 23-26	200'000	0
CH1236363417	2.0125 % Nationwide Building Society 23-30	200'000	0
CH1236363425	2.4875 % Cooperatieve Rabobank U.A. 23-29 NT	200'000	0
CH1239464659	1.95 % Ctrle EM de Logements CCL 23-43	200'000	0
CH1239464691	3 % Allreal Holding 23-28	200'000	0
CH1239464709	2 3/4 % ZKB 23-28	300'000	0
CH1239464816	2 1/4 % PSP Swiss Property 23-28	200'000	0
CH1239494979	1.7125 % Aktiebolaget Svensk Exportkredit 23-30	200'000	0
CH1242301286	2.61 % Swiss Life Holding 23-32	300'000	0
CH1242969199	2.30 % Banque Federative du Credit Mutuel 23-27 NT	200'000	0
CH1243018798	1.585 % AWAG P.S.K. Wohnbaubank 23-26 Series 23 Tranche 1	200'000	0
CH1243018806	2.745 % Lloyds Banking Group 23-27 NT	400'000	0
CH1243651911	1.715 % National Australia Bank 23-33	200'000	0
CH1243651937	2.35 % KW Linth-Limmern 23-27	200'000	0
CH1243651945	2 3/4 % KW Linth-Limmern 23-30	200'000	0
CH1243651952	1 7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-31 series 734	1'500'000	0
CH1243651994	2.10 % Lonza Swiss Finanz 23-29	300'000	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

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	35

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH1243933566	3.13 % HIAG Immobilien Holding 23-29	100'000	0
CH1243933582	1.8925 % Korea Housing Finance 23-28 Tranche 2	300'000	0
CH1244321761	2.63 % BNP Paribas 23-29 NT	200'000	0
CH1244321779	1 5/8 % Municipality Finance 23-28 NT	200'000	0
CH1244321803	1 1/2 % Nordic Investment Bank 23-28 NT	200'000	0
CH1244731753	2 5/8 % DZ BANK 23-29	200'000	0
CH1245295758	3.2625 % Commerzbank 23-27 NT	400'000	0
CH1248666963	2.8925 % Banco de Credito e Inversiones 23-28 NT	200'000	0
CH1249151049	1 3/4 % Caisse des Depots et Consignations 23-31 NT	200'000	0
CH1249416004	2.5413 % Credit Agricole 23-30	200'000	0
CH1249416012	2.70 % SpareBank 1 Nord-Norge 23-29 NT	200'000	0
CH1249416020	1.9925 % Akademiska Hus 23-33 NT	200'000	0
CH1249416046	2 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-30 Series 736	1'800'000	0
CH1251030107	1.903 % Compagnie de Financement Foncier 23-28	200'000	0
CH1251998220	2.35 % Grande Dixence 23-30	200'000	0
CH1253456078	2 1/4 % Sika 23-26	300'000	0
CH1255924404	2.70 % Ferring Holding 23-27	200'000	0
CH1255924412	3 1/4 % Ferring Holding 23-31	200'000	0
CH1255924453	2.35 % Galenica 23-29	200'000	0
CH1255924461	2.65 % Massmutual Global Funding II 23-28 Series 2023-4	200'000	0
CH1261608900	2.8325 % DZ BANK 23-29	200'000	0
CH1264414322	3.80 % Commerzbank 23-28 NT	200'000	0
CH1264414348	2.13 % Toyota Motor Finance 23-27	200'000	0
CH1264823431	2.04 % Province of Quebec 23-33 NT	200'000	0
CH1265890660	1.45 % Kanton Bern 23-30	250'000	0
CH1265890736	1 1/2 % Stadt Winterthur 24-54	350'000	0
CH1265890801	1.60 % Basler KB 24-31 Series 004	100'000	0
CH1265890827	1.60 % Basler KB 24-44	250'000	0
CH1266477004	2.355 % Ville de Lausanne 23-74	200'000	0
CH1266847131	2.665 % Cembra Money Bank 23-30	400'000	0
CH1266847156	1.90 % Swissgrid 23-26	200'000	0
CH1266847172	2.40 % Kenova 23-38	400'000	100'000
CH1268922205	2 7/8 % OC Oerlikon Corporation 23-26	500'000	0
CH1270609485	1.85 % Valiant Bank 23-28	300'000	0
CH1270825529	4.2525 % Muenchener Hypothekenbank 23-33 NT	200'000	0
CH1270825545	2.8575 % NatWest Markets 23-28	400'000	0
CH1271007952	2 3/8 % HYPO NOE Landesbank Niederoesterreich und Wien 24-29	200'000	0
CH1271360385	2.0125 % Westpac Banking 23-30	350'000	0
CH1271360401	2.7725 % Swedbank 23-28 NT	200'000	0
CH1271360567	1 5/8 % Credit Agricole next bank (Suisse) 22-29	200'000	0
CH1271360575	1 3/4 % Asian Infrastructure Investment Bank 23-30 NT	200'000	0
CH1271360583	1.81 % Kommunalbanken 23-30 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

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	36

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH1271360609	1.6275 % NRW Bank 23-28 NT	200'000	0
CH1271360625	2 7/8 % Equinix 23-28	200'000	0
CH1271360641	2.0275% Korea Railroad 23-25	300'000	0
CH1273429691	2.685 % DNB Bank 23-28 NT	400'000	0
CH1273475389	1.94 % Commonwealth Bank of Australia 23-30	400'000	0
CH1273475397	1 7/8 % Nestle 23-29	500'000	0
CH1273475405	2 % Nestle 23-33	400'000	0
CH1273475413	2 1/8 % Nestle 23-38	200'000	0
CH1274703110	1.8984 % Credit Agricole next bank (Suisse) 23-26	100'000	0
CH1274703144	1.60 % Luzerner KB 24-44	750'000	150'000
CH1274703151	2.63 % Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich 23-28	300'000	0
CH1276269730	2.73 % Banque Federative du Credit Mutuel 23-30 NT	200'000	0
CH1276313256	2 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-40 Series 740	200'000	0
CH1276313264	1 7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-50 Series 741	200'000	0
CH1276313314	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-33 Series 742	220'000	0
CH1277080508	1.885 % Deutsche Bahn Finance 23-35	400'000	0
CH1277582008	2.34 % ENGIE 23-27 NT	200'000	0
CH1277582016	2.49 % ENGIE 23-31 NT	200'000	0
CH1279261130	4.2425 % Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale 23-33 NT	400'000	0
CH1279261148	1.8375 % CFF 23-30 NT	200'000	0
CH1279261155	2.2225 % The Korea Development Bank 23-26 NT	300'000	0
CH1280154290	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-43 Series 744	2'000'000	280'000
CH1280154324	1 3/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-49 Series 746	280'000	0
CH1280155461	1.80 % St.Galler KB 23-33	400'000	0
CH1280994299	2.97 % Nationwide Building Society 23-27	600'000	0
CH1289657111	2 % Emmi Finanz 23-28	200'000	0
CH1289657137	2.201 % National Australia Bank 23-29	200'000	0
CH1290222285	2 3/8 % Bank Julius Baer & Co, Guernsey Branch 23-27	400'000	0
CH1290222293	2 1/2 % Bank Julius Baer & Co, Guernsey Branch 23-30	100'000	0
CH1290222301	2.40 % Kantonsspital St. Gallen 23-33	400'000	0
CH1290222327	1 7/8 % Ville de Lausanne 23-76	250'000	0
CH1290222509	1.70 % Cantone Ticino 23-33	100'000	0
CH1290222566	2.30 % SGS 23-31	200'000	0
CH1290870901	2 3/4 % Clariant 23-28 NT	200'000	0
CH1290870950	2 1/8 % Sandoz Group 23-26	300'000	0
CH1290870968	2.60 % Sandoz Group 23-31 NT	200'000	0
CH1290870976	2.1225 % BNP Paribas 24-32	400'000	0
CH1290870992	1.5825 % SNCF 24-39 NT	100'000	0
CH1290871008	2.395 % Banco Santander 24-29 NT	100'000	0
CH1290871016	2.24 % Banco Santander 24-32	300'000	100'000
CH1290871024	1.5125 % RATP 24-36 NT	200'000	0
CH1290871040	1 7/8 % Metropolitan Life Global Funding I 24-31 NT	400'000	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

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	37

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH1290991327	1 1/8 % Basellandschaftliche KB 24-34	100'000	0
CH1292012783	2.005 % Santander UK 23-29 Series 83	250'000	0
CH1293237975	1.965 % ABB 23-26	300'000	0
CH1293714338	2.7175 % Embotelladora Andina 23-28	200'000	0
CH1293714346	2 1/4 % Partners Group Holding 23-28	200'000	0
CH1293714353	2.40 % Partners Group Holding 23-33	200'000	0
CH1293714361	2 3/8 % Inselspital-Stiftung 23-31	200'000	0
CH1294486357	2.3625 % Credit Agricole 23-28 NT	400'000	0
CH1294486365	3.61 % DZ BANK 23-28	300'000	0
CH1296276152	2.47 % Achmea Bank 23-26 NT	400'000	0
CH1298665980	2.96 % Fresenius SE & Co. 23-28 NT	200'000	0
CH1298957064	2.6825 % Societe Generale 23-29 NT	200'000	0
CH1300224875	1.96 % MercedesBenz International Finance 23-26	200'000	0
CH1300224883	2.1075 % MercedesBenz International Finance 23-29 NT	100'000	0
CH1300277717	1.82 % UBS Switzerland 23-26	250'000	0
CH1300277725	2.035 % UBS Switzerland 23-33	400'000	0
CH1300277865	2.30 % Bell Food Group 23-26	200'000	0
CH1300950008	2.01 % Toyota Motor Finance (Netherlands) 23-26	200'000	0
CH1300950016	2.12 % Toyota Motor Finance 23-29 NT	200'000	0
CH1300950032	2.445 % Banco Santander Chile 24-27 NT	200'000	0
CH1305916731	2 3/8 % Givaudan 23-31	200'000	0
CH1305916780	1.95 % Roche Kapitalmarkt 23-38	200'000	0
CH1305916814	1.45 % Stadt Zuerich 23-42	300'000	0
CH1306117040	2 1/2 % Liechtensteinische Landesbank 23-30 NT	200'000	0
CH1306117107	1.30 % Centr. LdG Bques Cant. CH 23-28 Series 582	500'000	0
CH1306117131	1.70 % PSP Swiss Property 24-30	150'000	0
CH1310346312	1.35 % Stadt Zuerich 24-45	550'000	100'000
CH1310346320	1.30 % Cantone del Ticino 24-35	300'000	0
CH1314941407	1.778 % Korea Housing Finance 24-27	200'000	0
CH1314941423	1.95 % Barry Callebaut 24-28	200'000	0
CH1319968405	1 1/2 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-31 Series 585	3'200'000	0
CH1319968496	1.8% Swiss Prime Site Finance 24-30	200'000	0
CH1319968561	2 1/8 % ZKB 24-33	200'000	0
CH1319968611	1.40 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-34 Series 590	100'000	0
CH1319968629	1.40 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-38 Series 591	100'000	0
CH1319968694	1.45 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-39 Series 593	890'000	0
CH1321113453	2.2225 % Banque Federative du Credit Mutuel 24-32 NT	200'000	0
CH1321481462	1.5427 % UBS 24-27	150'000	0
CH1321481538	2 1/2 % Muenchener Hypothekenbank 24-30	200'000	0
CH1321508355	1.83 % Toyota 24-28 NT	250'000	0
CH1323274055	2 % LGT Bank 24-34 NT	200'000	0
CH1323274097	1.2375 % BNG Bank 24-29	300'000	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

Numéro de valeur classe A :	134 774 445
Numéro de valeur classe B :	134 774 446
Numéro de valeur classe C :	134 774 448
Numéro de valeur classe CP :	134 774 449
Numéro de valeur classe Z :	134 774 454
Numéro de valeur classe ZP :	134 774 455
Unité de compte du fonds :	CHF
Page	38

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
CH1325807845	2.0125% Abu Dhabi Commercial Bank 24-30	200'000	0
CH1326849630	1.5775 % Ville de Lausanne 24-78	200'000	0
CH1335850280	1.1525 % Nordic Investment Bank 24-31 NT	50'000	0
CH1335850298	1.4778 % Agence France Locale (AFL) 24-34 NT	200'000	0
CH1335850306	2.80 % Banco Internacional 24-27 NT	100'000	0
CH1337248970	1.20 % Kanton Bern 24-39	200'000	0
CH1341035009	1.5025 % Swiss Life Holding 24-30	100'000	0
CH1341035017	1.6575 % Swiss Life Holding 24-33	300'000	0
CH1341035025	1.75 % Berlin Hyp 24-28	100'000	0
CH1341035041	1 7/8 % New York Life Global Funding 24-32 NT	150'000	0
CH1344316695	1.5225 % Slovakia 24-28 NT	100'000	0
CH1344316703	1.915 % Slovakia 24-34 NT	100'000	0
CH1344316711	2.5925 % FONPLATA 24-27 NT	50'000	0
CH1344316737	1.5225 % Province of Manitoba 24-34 NT	120'000	0
CH1344316745	1 3/8 % Nestle 24-28	50'000	0
CH1344316752	1 1/2 % Nestle 24-31	70'000	0
CH1344316760	1 5/8 % Nestle 24-34	160'000	0
CH1344316778	1 3/4 % Nestle 24-40	260'000	0
CH1346742856	2.10 % Kantonsspital Aarau 24-34	50'000	0
CH1346742864	1 1/2 % Banque Cantonale de Neuchatel 24-34	80'000	0
CH1346742898	1.65 % Viseca Payment Services 24-28	100'000	0
CH1346742914	2.40 % St.Galler KB 24-34	280'000	0
CH1346742930	1.90 % Partners Group Holding 24-30	200'000	0
CH1346742989	1.45 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-34 Series 594	160'000	0
CH1346742997	1.45 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-39 Series 595	300'000	0
CH1346743011	1.85 % WWZ 24-38	100'000	0
CH1346743029	2.05 % Mobimo Holding 24-30	150'000	0
CH1346743052	1.30 % Kanton Zuerich 24-37	650'000	0
CH1346743060	1 3/4 % Coop-Gruppe Genossenschaft 24-28	200'000	0
CH1346743078	1.85 % Coop-Gruppe Genossenschaft 24-32	200'000	0
CH1346743094	1.6 % Banca dello Stato del Cantone Ticino 24-36	250'000	0
CH1348614061	2.40 % Barry Callebaut 24-34	70'000	0
CH1348614129	1.65 % Sika 24-29	50'000	0
CH1348614137	1 7/8 % Sika 24-33	260'000	0
CH1348614145	1 3/4 % Baloise-Holding 24-34	100'000	0
CH1348614152	2.1125 % UBS Group 24-30 var	200'000	0
CH1348614160	2.0975 % Aguas Andinas 24-29	50'000	0
CH1348614194	1.30 % Stadt Zuerich 24-49	300'000	0
CH1348614202	1.5075 % UBS Switzerland 24-29	500'000	0
CH1348968657	1.60 % Graubuender KB 24-34	100'000	0
CH1350727785	1.65 % Swisscom 24-30 NT	300'000	0
CH1350727793	1.80 % Swisscom 24-34 NT	300'000	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)
CH1350727801	2 % Swisscom 24-39 NT	120'000	0
CH1353015006	1 1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 24-28 Series 756	200'000	0
CH1353015022	1 3/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 24-37 Series 757	250'000	0
CH1353015030	1 1/4 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 24-47 Series 758	100'000	0
CH1353257749	1.3175 % BNG Bank 24-39	200'000	0
CH1353257756	2 1/4 % Ferring Holding 24-29 Reg S	100'000	0
CH1353257814	1.65 % Novartis 24-31 NT	150'000	0
CH1353257822	1 3/4 % Novartis 24-34 NT	200'000	0
CH1353257830	1.85 % Novartis 24-40 NT	100'000	0
CH1353257848	1.85 % Novartis 24-49 NT	100'000	0
CH1353257863	1.95 % Helvetia Compagnie Suisse d'Assurances 24-34	200'000	0
CH1353257913	1.995 % EFG Bank 24-27	100'000	0
CH1353257921	2.1575 % EFG Bank 24-30	100'000	0
CH1353257939	1 5/8 % Kraftwerke Oberhasli 24-32	100'000	0
CH1356197108	2.15 % TRATON Finance Luxembourg 24-27 NT	100'000	0
CH1357852651	1.6925 % Stadler Rail 24-29	100'000	0
CH1357852669	1.995 % Stadler Rail 24-32	100'000	0
CH1357852685	1.5625 % Iberdrola Finanzas S.A.U 24-31	100'000	0
CH1357852693	1.65 % Swiss Prime Site Finance 24-29	100'000	0
CH1357852750	1.51 % Berlin Hyp 24-30 NT	100'000	0
CH1357852792	0.96 % Treasury Corp of Victoria 24-34 NT	100'000	0
CH1357852800	2 % Vonovia 24-31	100'000	0
CH1357852826	1.3075 % SpareBank 1 Nord-Norge 24-30 NT	100'000	0
CH1359203382	2.345 % Banco Santander 24-31 NT	100'000	0
CH1361401719	1 1/4 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-33 Series 596	500'000	0
CH1361401727	1.30 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-39 Series 597	600'000	0
CH1361401735	1.30% IWB Industrielle Werke Basel 24-29	100'000	0
CH1361401743	1.40% IWB Industrielle Werke Basel 24-34	100'000	0
CH1361401842	1 1/8 % ZKB 24-34	100'000	0
CH1361401867	1.20 % BCV 24-36	100'000	0
CH1361401883	1 1/8 % Geberit 24-31	150'000	0
CH1361401891	1.5606 % Burckhardt Compression Holding 24-28	75'000	0
CH1366517105	1.13 % Thurgauer KB 24-44	200'000	0
CH1371736757	1 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 24-33 Series 759	500'000	0
CH1371736765	1 1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 24-39 Series 760	300'000	0
CH1371736807	0.985 % Roche Kapitalmarkt 24-29	100'000	0
CH1371736815	1.0975 % Roche Kapitalmarkt 24-34	200'000	0
CH1371736823	1.17 % Roche Kapitalmarkt 24-39	100'000	0
CH1371736831	1.4875 % Federation Des Caisses Desjardins Du Quebec 24-29	100'000	0
CH1373904387	1.30 % kenova 24-34	100'000	0
CH1373904395	0.95 % Centrale d'Emission pour la const. de Logements 24-44	100'000	0
CH1373904403	1.60 % Galderma Holding 24-28	100'000	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)
CH1373904429	1 1/2 % Universitaetsspital Zurich 24-32	100'000	0
CH1377443804	1.65 % Zug Estates Holding 24-31	100'000	0

Positions fermées en cours de période comptable

Obligations

CH0119577721	2 % SNCF 10-34 NT	200'000	200'000
CH0184249990	1 1/2 % Confederation Suisse 13-25	1'600'000	1'600'000
CH0270191007	1.05 % Novartis 15-35	200'000	200'000
CH0282019006	1 1/4 % Services Industriels de Geneve 15-25	200'000	200'000
CH0545766609	0.05 % Hilti 20-25	250'000	250'000
CH0557779011	0 % Confederation Suisse 24-34	200'000	200'000
CH0557779029	1 1/4 % Confederation Suisse 24-43	250'000	250'000
CH0564642046	1/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 20-40 Series 692	640'000	640'000
CH1148308732	3/8 % Givaudan 21-30 Tranche B	200'000	200'000
CH1353257897	2 7/8 % Banque LdG Ets CH Credit Hypoth. 23-50 Series 741	100'000	100'000
CH1361401701	1.30 % Centr. LdG Bques Cant. CH 24-28 Series 582	500'000	500'000

1) Les achats englobent entre autres les transactions suivantes: achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions/en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions droits de souscription et d'options
 2) Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes: ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés

Notes aux états financiers

Commissions

BCV INDEX FUND – BCV Swiss Responsible Bond Indexed	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	0.19%*	Max. 1.75%	Max. 0.80%	
Classe B	0.12%*			
Classe C	0.07%*			
Classe CP	0.07%*			
Classe Z	0.00%			
Classe ZP	0.00%			

* 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.

La valeur des instruments du marché monétaire qui ne sont pas négociés en bourse ou sur un autre marché réglementé ouvert au public est déterminée de la manière suivante : le prix d'évaluation des placements est adapté successivement au prix de rachat, en partant du prix net d'acquisition, avec maintien constant du rendement de placement calculé en résultant. En cas de changements notables des conditions du marché, la base d'évaluation des différents placements est adaptée au nouveau rendement du marché. En l'absence d'un prix de marché actuel, on se réfère généralement à l'évaluation d'instruments du marché monétaire présentant des caractéristiques identiques (qualité et siège de l'émetteur, monnaie d'émission, durée).

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.

Les contrats à terme (contrats futures et forwards) et les contrats d'options négociés en bourse ou sur un autre marché réglementé ouvert au public sont évalués sur la base du prix de clôture ou de règlement publié par la bourse ou l'autre marché réglementé ouvert au public qui constitue le marché principal de ces contrats. Les contrats à terme et d'options qui ne sont pas négociés en bourse ou sur un autre marché réglementé ouvert au public (dérivé OTC) sont évalués au moyen de modèles d'évaluation appropriés et reconnus par la pratique, sur la base de la valeur vénale des sous-jacents.

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

		2024 au 31 août
Performance :		
– Classe A (lancée le 16.05.24)	%	2.58
– Classe B (lancée le 16.05.24)	%	2.60
– Classe C (lancée le 16.05.24)	%	2.62
– Classe CP (lancée le 16.05.24)	%	2.62
– Classe Z (lancée le 16.05.24)	%	2.64
– Classe ZP (lancée le 16.05.24)	%	2.64
Performance de l'indice de référence :		
Swiss Responsible Bond Index TR	%	2.95
Ecart de suivi (Tracking Error):		
– Classe A (lancée le 16.05.24)	%	0.30
– Classe B (lancée le 16.05.24)	%	0.30
– Classe C (lancée le 16.05.24)	%	0.30
– Classe CP (lancée le 16.05.24)	%	0.30
– Classe Z (lancée le 16.05.24)	%	0.30
– Classe ZP (lancée le 16.05.24)	%	0.30

Notes

1. La performance a été calculée et est publiée conformément à la directive de l'Asset Management Association Switzerland AMAS.
2. 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).
3. Ecart de suivi (Tracking Error): écart-type annualisé de la différence entre la performance de la classe et celle de l'indice de référence.
4. Pour la période du 16 mai 2024 au 31 août 2024, l'écart entre la performance du fonds et celle de l'indice de référence s'explique par le bid-ask spread d'exécution au jour du lancement.
5. 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 BCV INDEX FUND avec les compartiments :

- BCV SPI Indexed
- BCV SPI 20 Indexed
- BCV Swiss Responsible Equity Indexed
- BCV Swiss Responsible Bond Indexed

comprenant le compte de fortune au 31 août 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.

Autres informations

La responsabilité des autres informations incombe au Conseil d'administration de la direction de fonds. Les autres informations comprennent toutes les informations présentées dans le rapport annuel, à l'exception des comptes annuels et de notre rapport correspondant.

Notre opinion sur les comptes annuels ne s'étend pas aux autres informations et nous n'exprimons aucune conclusion d'audit sous quelque forme que ce soit sur ces informations.

Dans le cadre de notre audit des états financiers, notre responsabilité consiste à lire les autres informations et, ce faisant, à apprécier si elles présentent des incohérences significatives par rapport aux comptes annuels ou aux connaissances que nous avons acquises au cours de notre audit ou si elles semblent par ailleurs comporter des anomalies significatives.

Si, sur la base des travaux que nous avons effectués, nous arrivons à la conclusion que les autres informations présentent une anomalie significative, nous sommes tenus de le déclarer. Nous n'avons aucune remarque à formuler à cet égard.

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
Expert-réviseur agréé
Auditeur responsable

Mathilde de La Pomélie
Expert-révisseuse agréée

Lausanne, 16 décembre 2024

Annexe:

- Comptes annuels comprenant le compte de fortune au 31 août 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)