

AMC PROFESSIONAL FUND - BCV Fiscal Strength Government Bonds

Rapport semestriel au 30 septembre 2023

Table des matières

Direction du fonds et organisation	2
Information aux investisseurs	3
Chiffres comptables	4
Inventaire et transactions	7
Notes aux états financiers	30
Rapport de performance	31



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

Les chiffres et indications mentionnés dans ce rapport font référence à des événements passés et n'offrent aucune garantie quant aux résultats futurs.

Direction du fonds et organisation

Direction du fonds

GERIFONDS SA
Rue du Maupas 2
Case postale 691
1001 Lausanne

Conseil d'administration

Stefan BICHSEL
Président

Oren-Olivier PUDER
Vice-président

Fabrice WELSCH
Membre

Patrick BOTTERON
Membre

Simona TERRANOVA
Membre

Organe de gestion

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

Banque dépositaire

Banque Cantonale Vaudoise, Lausanne

Société d'audit

PricewaterhouseCoopers SA
Avenue Giuseppe-Motta 50
1202 Genève

Domicile(s) de souscription et de paiement

Banque Cantonale Vaudoise, Lausanne

Gestion du fonds

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

Information aux investisseurs

1) Changement de société d'audit

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

2) Distribution intermédiaire des revenus au 31 août 2023 pour la classe de parts C

Une partie importante des parts en circulation de la classe de parts C a été demandée au remboursement le 31 août 2023.

Conformément aux exigences de l'Administration fédérale des contributions AFC, une distribution intermédiaire des revenus a eu lieu pour cette classe de parts le 31 août 2023 (date d'exécution) et payée le 4 septembre 2023 (date de paiement).

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

				Montant pour porteurs de parts domiciliés			
				en Suisse			à l'étranger
Classe de parts	Affidavit	Coupon	Monnaie	Brut par part	Impôt anticipé fédéral moins 35%	Net par part	Brut/Net par part
C	Oui	No 7	CHF	0.67781	0.23723	0.44058	0.67781

Chiffres comptables

Aperçu	Devise		01.04.23	01.04.22	01.04.21
			30.09.23	31.03.23	31.03.22
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	consolidée	CHF	458'063'705.25	491'990'396.74	472'212'471.97
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	classe B	CHF	3'315'210.76	3'025'338.79	3'388'893.17
Valeur nette d'inventaire d'une part à la fin de la période comptable	classe B	CHF	74.45	81.25	91.80
Total Expense Ratio (TER)	classe B		0.42%	0.42%	0.42%
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	classe C	CHF	51'587'533.19	161'792'200.45	76'229'906.94
Valeur nette d'inventaire d'une part à la fin de la période comptable	classe C	CHF	74.14	81.69	92.31
Total Expense Ratio (TER)	classe C		0.32%	0.32%	0.32%
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	classe Z	CHF	403'160'961.30	327'172'857.50	392'593'671.86
Valeur nette d'inventaire d'une part à la fin de la période comptable	classe Z	CHF	74.77	81.79	92.54
Total Expense Ratio (TER)	classe Z		0.11%	0.11%	0.11%

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

Compte de fortune (Valeurs vénales)	30.09.23	31.03.23
Avoirs en banque		
à vue	10'116'833.70	23'712'137.61
Valeurs mobilières		
Obligations, obligations convertibles, emprunts à option et autres titres de créance et droits-valeurs	445'102'927.85	464'731'964.57
Instruments financiers dérivés	-631'461.37	-15'954.95
Autres actifs	3'678'943.76	3'629'122.31
Fortune totale du fonds à la fin de la période comptable	458'267'243.94	492'057'269.54
Engagements envers les banques à court terme	-160'330.53	0.00
Autres engagements	-43'208.16	-66'872.80
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	458'063'705.25	491'990'396.74

Evolution du nombre de parts de la classe B	Période comptable	01.04.23	01.04.22
		30.09.23	31.03.23
Position au début de la période comptable		37'236	36'916
Parts émises		7'747	1'945
Parts rachetées		-453	-1'625
Position à la fin de la période comptable		44'530	37'236

Evolution du nombre de parts de la classe C	Période comptable	01.04.23	01.04.22
		30.09.23	31.03.23
Position au début de la période comptable		1'980'466	825'805
Parts émises		126'042	1'175'695
Parts rachetées		-1'410'687	-21'034
Position à la fin de la période comptable		695'821	1'980'466

Evolution du nombre de parts de la classe Z	Période comptable	01.04.23	01.04.22
		30.09.23	31.03.23
Position au début de la période comptable		4'000'333	4'242'427
Parts émises		1'391'641	186'880
Parts rachetées		0	-428'974
Position à la fin de la période comptable		5'391'974	4'000'333

Variation de la fortune nette du fonds		
Fortune nette du fonds au début de la période comptable	491'990'396.74	472'212'471.97
Distribution prévue lors de la dernière clôture annuelle	-9'221'592.00	-8'416'243.70
Distribution intermédiaire des revenus	-1'354'045.45	0.00
Solde des mouvements de parts	10'884'041.31	72'729'317.77
Résultat total	-34'235'095.35	-44'535'149.30
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	458'063'705.25	491'990'396.74

Compte de résultat	Période comptable	01.04.23	01.04.22
		30.09.23	31.03.23
Revenus			
Revenus des avoirs en banque			
à vue		22'930.86	19'054.40
Intérêts négatifs		0.00	-15'670.79
Revenus des valeurs mobilières			
Obligations, obligations convertibles, emprunts à option et autres titres de créance et droits-valeurs		5'707'967.17	9'184'318.48
Participation des souscripteurs aux revenus nets courus		524'058.26	1'442'618.64
Total des revenus		6'254'956.29	10'630'320.73
Charges			
Intérêts passifs		-89'834.01	-38'661.94
Bonifications réglementaires			
Commission forfaitaire de gestion		-378'725.54	-620'735.67
Autres charges		-56'507.61	-72'320.86
Participation des porteurs de parts sortants aux revenus nets courus		-1'614.51	-548'759.34
Total des charges		-526'681.67	-1'280'477.81
Résultat net		5'728'274.62	9'349'842.92
Gains et pertes de capital réalisés		-23'569'417.96	-20'574'992.54
Résultat réalisé		-17'841'143.34	-11'225'149.62
Gains et pertes de capital non réalisés		-16'393'952.01	-33'309'999.68
Résultat total		-34'235'095.35	-44'535'149.30

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					407'784'191.28	88.98
Obligations						
AU0000013740	2 1/2 % Australia 18-30 NT	510'000	AUD	89.80758 %	270'419.68	0.06
AU0000097495	1 3/4 % Australia 20-51 Series 162 NT	900'000	AUD	52.9229 %	281'216.77	0.06
AU0000101792	1 % Australia 20-31	4'500'000	AUD	76.91019 %	2'043'391.06	0.45
AU000XCLWAG2	4 1/2 % Australia 13-33 Series 140 TB	4'160'000	AUD	100.27027 %	2'462'751.57	0.54
AU000XCLWAP3	3 1/4 % Australia 15-39 NT	1'350'000	AUD	83.75727 %	667'592.41	0.15
AU000XCLWAR9	2 1/4 % Australia 16-28 NT	2'940'000	AUD	92.1914 %	1'600'268.43	0.35
AU3TB0000135	4 3/4 % Australia 11-27 NT Series 136 TB	4'989'000	AUD	102.16366 %	3'009'296.95	0.64
AU3TB0000168	3 1/4 % Australia 13-25 NT Series 139 TB	1'170'000	AUD	98.61263 %	681'198.23	0.15
AU3TB0000192	3 3/4 % Australia 14-37 Series 144 NT	432'000	AUD	91.24878 %	232'737.26	0.05
Australie					11'248'872.36	2.45
AT0000A0U299	3.80 % Oesterreich 12-62	195'000	EUR	102.8828 %	194'311.90	0.04
AT0000A10683	2.40 % Oesterreich 13-34	316'000	EUR	90.70121 %	277'601.74	0.06
AT0000A1FAP5	1.20 % Oesterreich 15-25	1'980'000	EUR	95.95774 %	1'840'209.41	0.40
AT0000A1K9C8	3/4 % Oesterreich 16-26	450'000	EUR	93.04342 %	405'527.40	0.09
AT0000A1K9F1	1 1/2 % Oesterreich 16-47	492'000	EUR	66.17876 %	315'359.38	0.07
AT0000A1VGK0	1/2 % Oesterreich 17-27	304'000	EUR	91.15402 %	268'393.18	0.06
AT0000A2CQD2	0 % Oesterreich 20-30 Series 1	1'000'000	EUR	81.42713 %	788'662.49	0.17
AT0000A2EJ08	3/4 % Oesterreich 20-51	550'000	EUR	50.82842 %	270'764.26	0.06
AT0000A2KQ43	0 % Oesterreich 20-40 NT	400'000	EUR	54.33338 %	210'498.39	0.05
AT0000A2NW83	0 % Oesterreich 21-31	700'000	EUR	78.56711 %	532'673.21	0.12
AT0000A2WSC8	0.90 % Oesterreich 22-32	770'000	EUR	82.20182 %	613'047.61	0.13
AT0000A33SK7	3.15 % Oesterreich 23-53	100'000	EUR	90.6036 %	87'754.11	0.02
Autriche					5'804'803.08	1.27
BE0000320292	4 1/4 % Belgique 10-41 Unitary 60 OLO	500'000	EUR	105.39296 %	510'391.74	0.11
BE0000326356	4 % Belgique 12-32 Unitary 66 OLO	1'000'000	EUR	104.7456 %	1'014'513.49	0.22
BE0000335449	1 % Belgique 15-31 Unitary 75 OLO	1'000'000	EUR	84.46047 %	818'041.92	0.18
BE0000337460	1 % Belgique 16-26 Unitary 77 OLO	400'000	EUR	94.36705 %	365'596.80	0.08
BE0000338476	1.60 % Belgique 16-47 Unitary 78 OLO	216'000	EUR	64.89671 %	135'768.34	0.03
BE0000339482	0.20 % Belgique 16-23 Unitary 79 OLO	566'000	EUR	99.81374 %	547'178.25	0.12
BE0000341504	0.80 % Belgique 17-27 Unitary 81 OLO	500'000	EUR	91.91194 %	445'106.55	0.10
BE0000343526	2 1/4 % Belgique 17-57 Unitary 83 OLO	150'000	EUR	69.51148 %	100'988.01	0.02
BE0000348574	1.70 % Belgique 19-50 Unitary 88 OLO	950'000	EUR	63.64362 %	585'599.28	0.13
BE0000349580	0.10 % Belgique 20-30 Unitary 89 OLO	750'000	EUR	81.38722 %	591'206.92	0.13
BE0000354630	0.35 % Belgique 22-32 Unitary 94 OLO	670'000	EUR	77.29068 %	501'561.26	0.11
Belgique					5'615'952.56	1.23
CA135087D358	2 3/4 % Canada 14-48 Series D 358 TB	180'000	CAD	82.12991 %	100'028.40	0.02

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
CA135087F825	1 % Canada 16-27 Series F825 TB	2'115'000	CAD	88.89507 %	1'272'147.54	0.28
CA135087H722	2 % Canada 17-51 Series H722 TB	1'880'000	CAD	68.48228 %	871'135.09	0.19
CA135087K940	1/2 % Canada 20-25 TB	500'000	CAD	92.15989 %	311'789.44	0.07
CA135087L930	1 % Canada 21-26 TB	2'300'000	CAD	90.50294 %	1'408'445.30	0.31
CA135087M276	1 1/2 % Canada 21-31 TB	4'000'000	CAD	83.08127 %	2'248'601.89	0.48
CA135087M680	1 3/4 % Canada 21-53 TB	200'000	CAD	63.14653 %	85'453.32	0.02
CA135087M920	3/4 % Canada 20-24 TB	1'550'000	CAD	98.58175 %	1'033'897.92	0.23
CA135087Q236	2 3/4 % Canada 23-33 TB	2'060'000	CAD	89.83459 %	1'252'161.26	0.27
CA135087XG49	5 3/4 % Canada 01-33 Series XG49 TB	900'000	CAD	113.37347 %	690'404.17	0.15
CA135087ZS68	3 1/2 % Canada 11-45 Series ZS68 TB	730'000	CAD	93.71356 %	462'886.77	0.10
Canada					9'736'951.10	2.12
CND1000014N5	3.91 % République Populaire de Chine 08-38 NT	4'200'000	CNY	113.59305 %	597'535.26	0.13
CND10001L774	3.54 % République Populaire de Chine 18-28 NT	8'000'000	CNY	105.35658 %	1'055'635.89	0.23
CND1000291L3	3.29 % République Populaire de Chine 19-29 NT	10'000'000	CNY	104.12216 %	1'304'084.26	0.28
CND100029RW4	3 1/4 % République Populaire de Chine 19-26 NT	15'000'000	CNY	102.65413 %	1'928'546.68	0.42
CND10002D1Y9	3.86 % République Populaire de Chine 19-49 NT	16'500'000	CNY	113.9843 %	2'355'545.33	0.51
CND10002HGP5	2.94 % République Populaire de Chine 19-24 NT	22'000'000	CNY	100.81313 %	2'777'808.10	0.61
CND10002M200	3.39 % République Populaire de Chine 20-50 NT	25'000'000	CNY	105.8563 %	3'314'508.80	0.72
CND100031JZ0	1.99 % République Populaire de Chine 20-25 NT	8'000'000	CNY	99.56031 %	997'559.31	0.22
CND100036Q75	2.68 % République Populaire de Chine 20-30 NT	11'000'000	CNY	99.95513 %	1'377'083.48	0.30
CND100037XX3	2.85 % République Populaire de Chine 20-27 NT	42'000'000	CNY	101.33009 %	5'330'281.96	1.16
CND100039ZX4	2.77 % République Populaire de Chine 20-30 NT	2'000'000	CNY	100.49866 %	251'740.29	0.05
CND10003N750	3.81 % République Populaire de Chine 20-50 NT	15'000'000	CNY	113.76936 %	2'137'366.71	0.47
CND10003R702	3.02 % République Populaire de Chine 20-25 NT	31'000'000	CNY	101.48483 %	3'940'263.85	0.86
CND100045210	3.03 % République Populaire de Chine 21-26 NT	6'000'000	CNY	101.6797 %	764'096.07	0.17
CND10004LLJ6	2.47 % République Populaire de Chine 21-24 NT	32'500'000	CNY	100.31542 %	4'083'321.08	0.89
CND10004NCM5	3.53 % République Populaire de Chine 21-51 NT	18'600'000	CNY	108.89068 %	2'536'682.59	0.55
CND10004TCP5	3.32 % République Populaire de Chine 22-52 NT	12'100'000	CNY	105.2973 %	1'595'750.90	0.35
CND10005F4L5	2 1/2 % République Populaire de Chine 22-27 NT	44'000'000	CNY	99.97713 %	5'509'545.86	1.20
CND10005L4G7	2.60 % République Populaire de Chine 22-32 NT	75'000'000	CNY	98.94988 %	9'294'777.44	2.04
CND10005QTD8	2.44 % République Populaire de Chine 22-27 NT	40'000'000	CNY	99.68717 %	4'994'151.56	1.09
Chine					56'146'285.42	12.25
CZ0001002547	5.70 % Czech Republic 09-24 Series 58	4'000'000	CZK	100.34981 %	159'624.44	0.03
CZ0001003859	2 1/2 % Czech Republic 13-28 Series 78	8'120'000	CZK	90.23528 %	291'376.96	0.06
CZ0001004477	0.95 % Czech Republic 15-30 Series 94	21'000'000	CZK	78.80626 %	658'116.63	0.15
CZ0001005243	2 % Czech Republic 17-33 Series 103	17'700'000	CZK	78.54085 %	552'830.12	0.12
CZ0001005888	1.20 % Czech Republic 20-31 Series 121	15'000'000	CZK	78.1624 %	466'242.63	0.10
CZ0001005920	1 1/2 % Czech Republic 20-40 Series 125	5'000'000	CZK	62.39336 %	124'059.84	0.03
République tchèque					2'252'250.62	0.49
DE0001102374	1/2 % Deutschland 15-25	380'000	EUR	96.20799 %	354'092.53	0.08
DE0001102390	1/2 % Deutschland 16-26	9'800'000	EUR	94.27984 %	8'948'844.15	1.96
DE0001102416	1/4 % Deutschland 17-27	6'000'000	EUR	91.77835 %	5'333'515.43	1.16
DE0001102432	1 1/4 % Deutschland 17-48	780'000	EUR	70.00135 %	528'838.50	0.12
DE0001102440	1/2 % Deutschland 18-28	8'300'000	EUR	90.86935 %	7'304'955.56	1.59

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
DE0001102481	0 % Deutschland 19-50	49'950	EUR	45.79847 %	22'156.88	0.00
DE0001102523	0 % Deutschland 20-27	5'000'000	EUR	89.3398 %	4'326'503.36	0.94
DE0001102549	0 % Deutschland 21-36	1'000'000	EUR	69.40969 %	672'267.58	0.15
DE0001102614	1.80 % Deutschland 22-53	3'170'000	EUR	76.18146 %	2'339'002.11	0.51
DE0001135366	4 3/4 % Deutschland 08-40	1'200'000	EUR	122.55284 %	1'424'382.60	0.31
DE0001135432	3 1/4 % Deutschland 10-42	2'450'000	EUR	103.03646 %	2'445'001.05	0.53
DE0001135481	2 1/2 % Deutschland 12-44	849'000	EUR	92.05472 %	756'964.99	0.17
DE000BU2Z007	2.30 % Deutschland 23-33	8'500'000	EUR	95.91602 %	7'896'453.96	1.72
Allemagne					42'352'978.70	9.24
DK0009922320	4 1/2 % Denmark 07-39 TB	7'000'000	DKK	116.54661 %	1'059'628.60	0.23
DK0009923567	1/2 % Denmark 17-27 TB	7'100'000	DKK	90.62329 %	835'707.25	0.18
DK0009923807	1/2 % Denmark 19-29 TB	5'200'000	DKK	86.51137 %	584'295.50	0.13
DK0009924029	1/4 % Denmark 20-52 TB	2'000'000	DKK	45.67741 %	118'655.38	0.03
DK0009924532	2 1/4 % Denmark 23-33 TB	1'200'000	DKK	92.7239 %	144'520.32	0.03
Danemark					2'742'807.05	0.60
ES00000121S7	4.70 % Espana 09-41 BS	800'000	EUR	104.76275 %	811'743.68	0.18
ES00000123X3	4.40 % Espana 13-23 BS	1'250'000	EUR	100.0296 %	1'211'045.82	0.26
ES00000124H4	5.15 % Espana 13-44 BS	486'000	EUR	110.71955 %	521'173.86	0.11
ES00000126Z1	1.60 % Espana 15-25 BS	2'500'000	EUR	97.01406 %	2'349'074.20	0.51
ES00000127A2	1.95 % Espana 15-30 BS	1'800'000	EUR	90.0752 %	1'570'362.00	0.34
ES00000128C6	2.90 % Espana 16-46 BS	1'020'000	EUR	78.63016 %	776'803.84	0.17
ES00000128P8	1 1/2 % Espana 17-27 BS	2'800'000	EUR	93.50801 %	2'535'880.99	0.56
ES0000012932	4.20 % Espana 05-37 BS	450'000	EUR	100.93066 %	439'903.76	0.10
ES0000012E51	1.45 % Espana 19-29 BS	1'060'000	EUR	89.66599 %	920'567.49	0.20
ES0000012F43	0.60 % Espana 19-29 BS	1'100'000	EUR	84.07675 %	895'757.89	0.20
ES0000012G00	1 % Espana 20-50 BS	830'000	EUR	46.84102 %	376'553.31	0.08
ES0000012I32	1/2 % Espana 21-31 BS	1'600'000	EUR	77.89583 %	1'207'136.03	0.26
ES0000012K46	1.90 % Espana 22-52 BS	230'000	EUR	58.41055 %	130'119.14	0.03
ES0000012K61	2.55 % Espana 22-32 BS	1'900'000	EUR	90.45925 %	1'664'671.83	0.36
Espagne					15'410'793.84	3.36
FI4000037635	2 3/4 % Finland 12-28 TB	633'000	EUR	98.18438 %	601'960.74	0.13
FI4000046545	2 5/8 % Finland 12-42 TB	220'000	EUR	86.82572 %	185'009.12	0.04
FI4000148630	3/4 % Finland 15-31 TB	950'000	EUR	83.31608 %	766'609.98	0.17
FI4000167317	7/8 % Finland 15-25 TB	500'000	EUR	95.43072 %	462'147.14	0.10
FI4000242870	1 3/8 % Finland 17-47 TB	240'000	EUR	65.75867 %	152'857.34	0.03
FI4000440557	1/4 % Finland 20-40 TB	200'000	EUR	57.75347 %	111'874.25	0.02
FI4000480488	1/8 % Finland 21-52 TB	300'000	EUR	40.06264 %	116'408.01	0.03
Finlande					2'396'866.58	0.52
FR0000187635	5 3/4 % France 01-32 OAT	3'000'000	EUR	118.62387 %	3'446'794.36	0.75
FR0010773192	4 1/2 % France 09-41 OAT	700'000	EUR	109.79187 %	744'372.40	0.16
FR0010870956	4 % France 10-60 OAT	350'000	EUR	102.26169 %	346'659.46	0.08
FR0010916924	3 1/2 % France 10-26 OAT	1'395'000	EUR	100.68098 %	1'360'328.13	0.30
FR0011461037	3 1/4 % France 13-45 OAT	820'000	EUR	92.07665 %	731'282.89	0.16

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
FR0011619436	2 1/4 % France 13-24 OAT	800'000	EUR	99.05473 %	767'515.65	0.17
FR0011962398	1 3/4 % France 14-24 OAT	132'000	EUR	97.99112 %	125'280.27	0.03
FR0012938116	1 % France 15-25 OAT	3'300'000	EUR	95.36506 %	3'048'072.35	0.67
FR0012993103	1 1/2 % France 15-31 OAT	5'100'000	EUR	88.58203 %	4'375'602.18	0.95
FR0013154044	1 1/4 % France 15-36 OAT	400'000	EUR	76.59456 %	296'742.63	0.06
FR0013250560	1 % France 17-27 OAT	2'000'000	EUR	92.68173 %	1'795'337.70	0.39
FR0013257524	2 % France 17-48 OAT	1'350'000	EUR	71.37796 %	933'297.12	0.20
FR0013286192	3/4 % France 17-28 OAT	900'000	EUR	89.80361 %	782'813.58	0.17
FR0013407236	1/2 % France 18-29 OAT	2'000'000	EUR	86.48944 %	1'675'386.94	0.37
FR0013480613	3/4 % France 19-52 OAT	1'840'000	EUR	47.22092 %	841'539.14	0.18
FR0013516549	0 % France 19-30 OAT	600'000	EUR	79.82933 %	463'912.20	0.10
FR001400CMX2	2 1/2 % France 22-43 OAT	300'000	EUR	82.12684 %	238'631.84	0.05
France					21'973'568.84	4.79
GB0032452392	4 1/4 % United Kingdom 03-36 TB	1'150'000	GBP	97.012 %	1'245'665.62	0.27
GB00B1VWPJ53	4 1/2 % United Kingdom 07-42 TB	2'600'000	GBP	96.15579 %	2'791'431.43	0.61
GB00B24FF097	4 3/4 % United Kingdom 07-30 TB	3'600'000	GBP	102.85119 %	4'134'185.82	0.90
GB00B3KJDS62	4 1/4 % United Kingdom 09-39 TB	1'552'000	GBP	94.4703 %	1'637'062.17	0.36
GB00B6RNH572	3 3/4 % United Kingdom 11-52 TB	3'700'000	GBP	82.8456 %	3'422'546.52	0.75
GB00BDRHNP05	1 1/4 % United Kingdom 17-27 TB	1'400'000	GBP	89.26911 %	1'395'427.90	0.30
GB00BFWFPP71	1 3/4 % United Kingdom 18-49 TB	3'000'000	GBP	55.10899 %	1'845'958.18	0.40
GB00BFX0ZL78	1 5/8 % United Kingdom 18-28 TB	1'275'000	GBP	88.15458 %	1'254'969.75	0.27
GB00BLH38158	1 1/4 % United Kingdom 21-51 TB	2'200'000	GBP	45.46878 %	1'116'899.74	0.24
GB00BM8Z2T38	1 % United Kingdom 21-32 TB	2'300'000	GBP	76.73174 %	1'970'520.83	0.43
GB00BMGR2809	1/4 % United Kingdom 20-31 TB	500'000	GBP	73.22308 %	408'786.15	0.09
GB00BMV7TC88	3 1/4 % United Kingdom 23-33 TB	2'000'000	GBP	90.96 %	2'031'227.76	0.44
GB00BPCJD997	3 3/4 % United Kingdom 23-53	500'000	GBP	82.41557 %	460'105.55	0.10
GB00BTHH2R79	2 % United Kingdom 15-25 TB	6'700'000	GBP	95.10629 %	7'114'792.26	1.57
Grande-Bretagne					30'829'579.68	6.73
HU0000403118	3 % Hungary 16-27 Series A	306'580'000	HUF	84.2408 %	644'165.67	0.14
HU0000403696	3 % Hungary 19-30 Series A	160'000'000	HUF	77.3627 %	308'732.88	0.07
Hongrie					952'898.55	0.21
IDG000010307	6 1/8 % Indonesia 12-28 Series FR0064	8'980'000'000	IDR	98.89879 %	525'761.80	0.11
Indonésie					525'761.80	0.11
IE00B6X95T99	3.40 % Ireland 14-24 TB	500'000	EUR	100.01851 %	484'364.62	0.11
IE00BH3SQ895	1.10 % Ireland 19-29 TB	1'514'000	EUR	89.71343 %	1'315'544.00	0.29
IE00BH3SQB22	1 1/2 % Ireland 19-50 TB	300'000	EUR	63.16446 %	183'533.81	0.04
IE00BJ38CR43	2.40 % Ireland 14-30 TB	461'000	EUR	95.70586 %	427'328.15	0.09
IE00BMD03L28	0.35 % Ireland 21-32 TB	1'000'000	EUR	77.71898 %	752'747.15	0.16
IE00BMQ5JL65	0 % Ireland 21-31 TB	750'000	EUR	77.6807 %	564'282.28	0.12
IE00BMQ5JM72	0.55 % Ireland 21-41 TB	700'000	EUR	60.3453 %	409'132.06	0.09
IE00BV8C9186	2 % Ireland 15-45 TB	400'000	EUR	75.34259 %	291'892.28	0.06
IE00BV8C9418	1 % Ireland 16-26 TB	500'000	EUR	94.71464 %	458'679.31	0.10

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
IE00BV8C9B83	1.70 % Ireland 17-37 TB	400'000	EUR	80.06564 %	310'190.33	0.07
Irlande					5'197'693.99	1.13
IL0011254005	5 1/2 % Israel 12-42	800'000	ILS	113.55244 %	218'287.94	0.05
IL0011393449	2 % Israel 16-27	800'000	ILS	92.59342 %	177'997.30	0.04
IL0011401937	3 3/4 % Israel 17-47	2'100'000	ILS	89.50058 %	451'635.87	0.10
IL0011508798	2 1/4 % Israel 18-28 Classe SHA	1'300'000	ILS	91.13748 %	284'697.49	0.06
IL0011806606	1.30 % Israel 21-32	2'900'000	ILS	79.15237 %	551'575.78	0.12
Israël					1'684'194.38	0.37
IT0005162828	2.70 % Italia 16-47 BT	2'100'000	EUR	68.65848 %	1'396'482.53	0.30
IT0005246340	1.85 % Italia 17-24 BT	1'650'000	EUR	98.74173 %	1'577'999.00	0.34
IT0005386245	0.35 % Italia 19-25 BT	2'500'000	EUR	95.41332 %	2'310'314.31	0.50
IT0005390874	0.85 % Italia 19-27 BT	3'000'000	EUR	90.53166 %	2'630'533.06	0.57
IT0005421703	1.80 % Italia 20-41 BT	900'000	EUR	63.1759 %	550'701.14	0.12
IT0005425233	1.70 % Italia 20-51 BT	200'000	EUR	51.83517 %	100'409.90	0.02
IT0005433690	1/4 % Italia 21-28 BT	3'800'000	EUR	84.5677 %	3'112'505.81	0.68
IT0005466013	0.95 % Italia 21-32 BT	7'500'000	EUR	74.60336 %	5'419'281.18	1.20
Italie					17'098'226.93	3.73
JP1103361EC6	1/2 % Japan 14-24 No 336	1'850'000	JPY	100.64733 %	11'414.47	0.00
JP1103541K42	0.10 % Japan 19-29 No 354	400'000'000	JPY	98.59978 %	2'417'784.95	0.53
JP1103631M74	0.10 % Japan 21-31 Series 363 TB	490'000'000	JPY	96.19524 %	2'889'557.86	0.63
JP1103701P43	1/2 % Japan 23-33 Series 370 TB	480'000'000	JPY	97.83405 %	2'878'809.82	0.63
JP12009917C3	2.10 % Japan 07-27 No 99	300'000'000	JPY	107.74468 %	1'981'521.61	0.43
JP1201081914	1.90 % Japan 09-28 No 108	234'450'000	JPY	108.02958 %	1'552'653.90	0.34
JP1201131990	2.10 % Japan 09-29 No 113	630'000'000	JPY	109.96419 %	4'246'914.77	0.93
JP1201231AC0	2.10 % Japan 10-30 No 123	320'000'000	JPY	110.89534 %	2'175'429.49	0.47
JP1201411CC4	1.70 % Japan 12-32 No 141	830'000'000	JPY	108.68327 %	5'529'966.46	1.22
JP1201501E99	1.40 % Japan 14-34 No 150	150'000'000	JPY	105.60878 %	971'120.28	0.21
JP1201511EC7	1.20 % Japan 14-34 No 151	173'000'000	JPY	103.35274 %	1'096'099.13	0.24
JP1201561G37	0.40 % Japan 16-36 No 156	280'000'000	JPY	93.18116 %	1'599'439.67	0.35
JP1201611H69	0.60 % Japan 17-37 No 161	250'000'000	JPY	93.97305 %	1'440'207.47	0.31
JP1201741LA9	0.40 % Japan 20-40 Series 174 TB	100'000'000	JPY	86.2917 %	528'993.99	0.12
JP1201751M13	1/2 % Japan 20-40 Series 175 TB	80'000'000	JPY	87.5109 %	429'174.48	0.09
JP1201781MA3	1/2 % Japan 21-41 No 178	101'000'000	JPY	86.40292 %	534'972.55	0.12
JP1300371C98	1.90 % Japan 12-42 No 37	484'950'000	JPY	108.17589 %	3'215'949.18	0.70
JP1300461F39	1 1/2 % Japan 15-45 No 46	450'000'000	JPY	100.02087 %	2'759'210.58	0.60
JP1300551H61	0.80 % Japan 17-47 No 55	150'000'000	JPY	85.26501 %	784'050.15	0.17
JP1300641KA3	0.40 % Japan 19-49 No 64	340'000'000	JPY	74.41663 %	1'551'067.39	0.34
JP1300691M16	0.70 % Japan 20-50 Series 69 TB	105'000'000	JPY	79.53583 %	511'957.43	0.11
JP1300711M79	0.70 % Japan 21-51 Series 71 TB	60'000'000	JPY	79.1429 %	291'101.85	0.06
JP1400051C51	2 % Japan 12-52 Series 5 TB	380'000'000	JPY	108.03313 %	2'516'646.98	0.55
JP1400081F45	1.40 % Japan 15-55 No 8	210'000'000	JPY	93.63619 %	1'205'437.72	0.26
Japon					43'119'482.18	9.41

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
LU1556942974	5/8 % Luxembourg 17-27	33'000	EUR	91.52357 %	29'252.90	0.01
Luxembourg					29'252.90	0.01
MX0MGO000078	10 % Mexico 05-24 Series M BS	20'000	MXN	98.98538 %	104'211.42	0.02
MX0MGO0000H9	8 1/2 % Mexico 09-29 BS	80'000	MXN	93.91027 %	395'473.43	0.09
MX0MGO0000J5	8 1/2 % Mexico 09-38 BS	90'000	MXN	88.84906 %	420'929.70	0.09
MX0MGO0000P2	7 3/4 % Mexico 11-31 BS	1'469'000	MXN	88.39903 %	6'835'708.60	1.49
MX0MGO0000R8	7 3/4 % Mexico 11-42 BS	21'000	MXN	81.11368 %	89'665.97	0.02
MX0MGO000102	8 % Mexico 17-47 BS	41'000	MXN	82.64184 %	178'360.24	0.04
Mexique					8'024'349.36	1.75
MYBMO1700040	3.899 % Malaysia 17-27 Series 17/0004 NT	4'300'000	MYR	100.7196 %	843'820.07	0.18
Malaisie					843'820.07	0.18
NL0000102234	4 % Niederlande 05-37	1'200'000	EUR	107.74376 %	1'252'262.65	0.27
NL0009446418	3 3/4 % Niederlande 10-42	1'076'000	EUR	106.09428 %	1'105'671.93	0.24
NL0010071189	2 1/2 % Niederlande 12-33	1'300'000	EUR	95.04068 %	1'196'671.50	0.26
NL0010721999	2 3/4 % Niederlande 14-47	1'200'000	EUR	91.75609 %	1'066'444.27	0.23
NL0011819040	1/2 % Niederlande 16-26	1'500'000	EUR	93.20768 %	1'354'144.40	0.30
NL0012171458	3/4 % Niederlande 17-27	2'200'000	EUR	92.08532 %	1'962'163.10	0.43
NL0012818504	3/4 % Niederlande 18-28 Unitary 1444A	1'800'000	EUR	90.07977 %	1'570'441.65	0.34
NL0015000RP1	1/2 % Noederlande 20-32	750'000	EUR	80.14287 %	582'167.86	0.13
NL0015614579	0 % Niederlande 20-52	600'000	EUR	41.2907 %	239'952.64	0.05
Pays-Bas					10'329'920.00	2.25
NO0010705536	3 % Norway 14-24 TB	1'316'000	NOK	99.39529 %	112'453.16	0.02
NO0010786288	1 3/4 % Norway 17-27 TB	4'431'000	NOK	92.58866 %	352'703.29	0.08
NO0010875230	1 3/8 % Norway 20-30 TB	19'100'000	NOK	84.37673 %	1'385'498.34	0.30
Norvège					1'850'654.79	0.40
NZGOVDT427C1	4 1/2 % New Zealand 14-27 NT	720'000	NZD	97.17708 %	384'581.66	0.08
NZGOVDT433C9	3 1/2 % New Zealand 15-33 NT	8'330'000	NZD	86.5222 %	3'961'546.73	0.87
NZGOVDT541C9	1 3/4 % New Zealand 20-41 NT	1'200'000	NZD	57.75263 %	380'930.07	0.08
Nouvelle-Zélande					4'727'058.46	1.03
PL0000107264	4 % Poland 12-23 Series DS1023	4'600'000	PLN	99.91729 %	963'242.11	0.21
PL0000109427	2 1/2 % Poland 16-27 Series DS0727	5'600'000	PLN	91.10372 %	1'069'205.33	0.24
PL0000112736	1 1/4 % Poland 20-30 Series DS1030	5'200'000	PLN	75.50466 %	822'837.52	0.18
PL0000115291	6 % Poland 22-33 Series DS1033	3'300'000	PLN	100.90 %	697'817.88	0.15
Pologne					3'553'102.84	0.78
PTOTECO0037	1 % Republique Portugaise 21-52 BT	200'000	EUR	48.06599 %	93'108.63	0.02
PTOTENO0034	0.90 % Republique Portugaise 20-35 BT	470'000	EUR	71.97217 %	327'630.61	0.07
PTOTE000033	0.30 % Republique Portugaise 21-31 BT	700'000	EUR	78.01548 %	528'933.27	0.12
PTOTEPO0032	1.15 % Republique Portugaise 22-42 BT	300'000	EUR	62.44155 %	181'433.29	0.04
PTOTEUOE0019	4 1/8 % Republique Portugaise 17-27 BT	155'000	EUR	103.08215 %	154'752.33	0.03
PTOTEVOE0018	2 1/8 % Republique Portugaise 18-28 BT	747'000	EUR	95.12423 %	688'230.34	0.15

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
Portugal					1'974'088.47	0.43
SG3254976487	2 3/4 % Singapore 12-42 NT	400'000	SGD	93.35662 %	250'282.47	0.05
SG7J60932174	3 1/2 % Singapore 07-27	263'000	SGD	100.13273 %	176'505.04	0.04
SG7S30941627	3 % Singapore 09-24	510'000	SGD	99.1819 %	339'022.03	0.07
SG7U32949426	2 7/8 % Singapore 10-30 NT	560'000	SGD	96.64827 %	362'750.03	0.09
SGXF27246101	1 7/8 % Singapore 20-50 TB	600'000	SGD	76.94894 %	309'442.01	0.07
SGXF46767848	2 5/8 % Singapore 22-32 TB	250'000	SGD	94.12951 %	157'721.60	0.03
Singapour					1'595'723.18	0.35
SK4120008871	3 3/8 % Slovakia 12-24 Series 223	300'000	EUR	99.63258 %	289'497.42	0.06
SK4120010430	1 3/8 % Slovakia 15-27 Series 228	82'000	EUR	93.13389 %	73'967.96	0.02
SK4120011420	1 5/8 % Slovakia 16-31 Series 229	200'000	EUR	85.79338 %	166'190.35	0.04
SK4120014184	2 1/4 % Slovakia 18-68	27'000	EUR	59.94783 %	15'676.87	0.00
SK4120015173	3/4 % Slovakia 19-30 Series 236	700'000	EUR	82.13172 %	556'840.73	0.12
Slovaquie					1'102'173.33	0.24
SI0002103487	1 1/2 % Slovenija 15-35	100'000	EUR	76.96553 %	74'544.96	0.02
SI0002103677	1 3/4 % Slovenija 16-40	100'000	EUR	70.66416 %	68'441.77	0.01
SI0002103685	1 1/4 % Slovenija 17-27	249'000	EUR	92.42681 %	222'904.76	0.05
SI0002104196	1/8 % Slovenija 21-31	300'000	EUR	76.58457 %	222'527.94	0.05
Slovénie					588'419.43	0.13
SE0004517290	2 1/4 % Sverige 12-32 Series 1056 TB	52'000'000	SEK	94.86379 %	4'153'674.16	0.90
SE0009496367	3/4 % Sverige 28 17-28 Series 1060 TB	7'000'000	SEK	90.19768 %	531'645.34	0.12
SE0013935319	1/8 % Sverige 20-31 Series 1062 TB	7'500'000	SEK	81.0205 %	511'663.89	0.11
Suède					5'196'983.39	1.13
TH062303I602	3.30 % Thailand 18-38 NT	7'000'000	THB	97.83304 %	172'051.53	0.04
TH062303Q605	2 7/8 % Thailand 16-46 NT	22'000'000	THB	87.3006 %	482'519.51	0.11
TH0623A3B608	3.65 % Thailand 10-31 NT	68'500'000	THB	103.75453 %	1'785'552.36	0.38
Thaïlande					2'440'123.40	0.53
US912810PW27	4 3/8 % USA 08-38 TB	3'506'000	USD	96.875 %	3'107'061.03	0.68
US912810QS06	3 3/4 % USA 11-41 TB	2'550'000	USD	86.51563 %	2'018'184.59	0.44
US912810QW18	3 % USA 12-42 TB	2'350'000	USD	76.51563 %	1'644'917.60	0.36
US912810RM27	3 % USA 15-45 TB	2'800'000	USD	74.25 %	1'901'869.20	0.42
US912810RV26	3 % USA 17-47 TB	4'700'000	USD	73.42188 %	3'156'817.57	0.69
US912810SN90	1 1/4 % USA 20-50 TB	1'900'000	USD	47.20313 %	820'446.96	0.18
US912810SQ22	1 1/8 % USA 20-40 TB	1'850'000	USD	56.82813 %	961'747.83	0.21
US912810SX72	2 3/8 % USA 21-51 TB	750'000	USD	63.45313 %	435'351.89	0.10
US912810TD00	2 1/4 % USA 22-52 Series 2052 TB	4'000'000	USD	61.40625 %	2'246'977.50	0.49
US912810TF57	2 3/8 % USA 22-42 TB	1'700'000	USD	69.125 %	1'075'004.35	0.23
US912810TJ79	3 % USA 22-52 TB	3'900'000	USD	72.90625 %	2'601'090.86	0.57
US9128282A70	1 1/2 % USA 26 16-26 Series E-2026 TB	12'800'000	USD	91.16406 %	10'674'801.25	2.33
US912828M565	2 1/4 % USA 15-25 Series F-2025 TB	3'500'000	USD	94.47656 %	3'024'950.60	0.66
US912828X885	2 3/8 % USA 17-27 Series C-2027 TB	19'000'000	USD	92.22656 %	16'030'083.37	3.50

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
US912828XT22	2 % USA 17-24 Series L-2024 TB	5'250'000	USD	97.72656 %	4'693'513.64	1.02
US91282CAU53	1/2 % USA 20-27 Series R-2027 TB	14'500'000	USD	84.59375 %	11'221'022.56	2.45
US91282CBW01	3/4 % USA 21-26 Series Y-2026 TB	4'200'000	USD	90.07031 %	3'460'645.53	0.76
US91282CCE93	1 1/4 % USA 21-28 Series L-2028 TB	16'400'000	USD	85.875 %	12'883'585.80	2.81
US91282CFV81	4 1/8 % USA 22-32 TB	2'000'000	USD	96.45313 %	1'764'706.37	0.39
US91282CGM73	3 1/2 % USA 23-33 TB	8'000'000	USD	91.76563 %	6'715'775.50	1.47
Etats-Unis					90'438'554.00	19.76
Instruments financiers dérivés					0.00	0.00
CBOT.UL11223	US ULTRABOND 10 YEAR	240	USD	111.5625	0.00*	0.00
EURX.BD1223	EUREX EURO BUND	350	EUR	128.64	0.00*	0.00
Futures					0.00*	0.00
Valeurs mobilières non cotées en bourse						
Obligations					37'318'736.54	8.15
IDG000009705	8 1/4 % Indonesia 11-32 Series FR0058	20'000'000'000	IDR	109.38967 %	1'295'173.63	0.28
IDG000012006	8 3/8 % Indonesia 13-24 Series FR0070	14'000'000'000	IDR	101.00587 %	837'136.67	0.18
IDG000012303	7 1/2 % Indonesia 17-38 Series FR0075	9'000'000'000	IDR	104.87509 %	558'774.48	0.12
IDG000012907	8.25 % Indonesia 18-29 Series FR0078	9'000'000'000	IDR	107.13986 %	570'841.15	0.12
IDG000018300	6.875 % Indonesia 21-51 Series FR0089	12'000'000'000	IDR	98.66634 %	700'925.66	0.15
IDG000018706	6 3/8 % Indonesia 21-32 Series FR0091	28'000'000'000	IDR	97.21968 %	1'611'513.35	0.36
IDG000018805	7 1/8 % Indonesia 21-42 Series FR0092	12'000'000'000	IDR	101.27651 %	719'468.30	0.16
Indonésie					6'293'833.24	1.37
KR103501GC90	3 1/8 % Republique de Coree 22-27 Series 03125-2709 (22-8)	4'600'000'000	KRW	97.07296 %	3'027'065.07	0.66
KR103501GD32	3 1/4 % Republique de Coree 23-28 Series 03250-2803(23-1)	1'400'000'000	KRW	97.21484 %	922'627.17	0.20
KR103502G3C1	3 3/4 % Republique de Coree 13-33 Series 03750-3312(13-8)	2'500'000'000	KRW	97.57371 %	1'653'630.48	0.36
KR103502G495	3 % Republique de Coree 14-24 Series 03000-2409(14-5)	5'600'000'000	KRW	99.42535 %	3'774'424.75	0.85
KR103502G4C9	2 3/4 % Republique de Coree 14-44 Series 02750-4412 (14-7)	1'300'000'000	KRW	83.15055 %	732'780.84	0.16
KR103502G636	2 % Republique de Coree 16-46 Series 02000-4603(16-1)	600'000'000	KRW	71.50458 %	290'837.71	0.06
KR103502G693	1 1/2 % Republique de Coree 16-36 Series 01500-3609(16-6)	582'380'000	KRW	74.9644 %	295'956.02	0.06
KR103502G735	2 1/8 % Republique de Coree 17-47 Series 02125-4703 (17-1)	1'400'000'000	KRW	72.70102 %	689'976.33	0.15
KR103502G792	2 1/4 % Republique de Coree 17-37 Series 02250-3709(17-5)	2'900'000'000	KRW	81.49243 %	1'602'067.73	0.35
KR103502G7C2	2 3/8 % Republique de Coree 17-27 Series 02375-2712(17-7)	4'800'000'000	KRW	93.97751 %	3'057'952.99	0.67
KR103502GA34	1 1/2 % Republique de Coree 20-50 Series 01500-5003 (20-2)	4'550'000'000	KRW	62.77919 %	1'936'389.52	0.42
KR103502GB33	1 7/8 % Republique de Coree 21-51 Series 01875-5103 (21-2)	3'000'000'000	KRW	67.3328 %	1'369'347.09	0.30
KR103502GB66	2 % Republique de Coree 21-31 Series 02000-3106 (21-5)	500'000'000	KRW	86.5061 %	293'212.41	0.06
KR103502GBC0	2 3/8 % Republique de Coree 21-31 Series 02375-3112 (21-11)	400'000'000	KRW	88.49913 %	239'974.24	0.05
KR103502GD31	3 1/4 % Republique de Coree 23-53 Series 03250-5303 (23-2)	1'550'000'000	KRW	88.72694 %	932'293.87	0.20
KR103503GC98	3 1/8 % Republique de Coree 22-24 Series 03125-2409 (22-10)	1'600'000'000	KRW	99.53261 %	1'079'570.50	0.24
Corée du Sud					21'898'106.72	4.79
MX0MGO0001D6	7 1/2 % Mexico 22-33 BS	440'000	MXN	85.41741 %	1'978'396.25	0.43
Mexique					1'978'396.25	0.43

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
MYBGT1900062	4.119 % Malaysia 19-34 Series 19/0006 NT	450'000	MYR	100.71981 %	88'306.94	0.02
MYBGX1500062	4.786 % Malaysia 15-35 Series 15/0006 NT	1'000'000	MYR	106.71908 %	207'926.34	0.05
MYBMO2000028	2.632 % Malaysia 20-31 Series 20/0002 NT	3'000'000	MYR	91.37902 %	534'115.47	0.12
MYBMO2200016	3.582 % Malaysia 22-32 Series 22/0001 NT	5'000'000	MYR	96.94626 %	944'427.21	0.21
MYBMS1900047	3.828 % Malaysia 19-34 Series 19/0004 NT	3'000'000	MYR	98.03619 %	573'027.01	0.13
MYBMT1800039	4.642 % Malaysia 18-33 Series 18/0003 NT	7'000'000	MYR	105.48026 %	1'438'588.68	0.30
MYBMX1000038	4.498 % Malaysia 10-30 Series 10/0003 NT	2'500'000	MYR	103.52237 %	504'245.05	0.11
MYBMY1900052	3.757 % Malaysia 19-40 Series 19/0005 NT	1'700'000	MYR	94.11426 %	311'725.09	0.07
MYBMZ1800051	4.921 % Malaysia 18-48 Series 18/0005 NT	710'000	MYR	107.16735 %	148'247.80	0.03
Malaisie					4'750'609.59	1.04
TH0623035605	0.95 % Thailand 20-25 NT	10'000'000	THB	97.3132 %	244'481.91	0.05
TH0623035C07	3.85 % Thailand 10-25 NT	19'700'000	THB	102.72841 %	508'430.69	0.11
TH0623039C03	1.60 % Thailand 19-29 NT	5'000'000	THB	92.53126 %	116'234.07	0.03
TH062303D603	3.35 % Thailand 22-33 NT	50'000'000	THB	101.33686 %	1'272'953.12	0.27
TH062303M604	2 % Thailand 20-42 NT	13'000'000	THB	78.28833 %	255'690.95	0.06
Thaïlande					2'397'790.74	0.52
Instruments financiers dérivés					-631'461.37	-0.14
DAT029536	10.10.23	189'282'312	JPY	1.00	1'160'357.36	0.25
DAT029536	10.10.23	-1'200'000	EUR	157.86388	-1'161'303.53	-0.25
DAT029537	10.10.23	1'200'000'000	JPY	1.00	7'356'360.00	1.61
DAT029537	10.10.23	-7'298'604	CHF	163.06351	-7'295'890.49	-1.59
DAT029538	10.10.23	213'763'875	JPY	1.00	1'310'436.68	0.29
DAT029538	10.10.23	-1'500'000	USD	149.06137	-1'370'686.38	-0.30
DAT029540	10.10.23	1'261'105'600	JPY	1.00	7'730'955.66	1.69
DAT029540	10.10.23	-8'000'000	EUR	157.86388	-7'742'023.52	-1.69
DAT029541	10.10.23	600'000'000	JPY	1.00	3'678'180.00	0.80
DAT029541	10.10.23	-3'644'016	CHF	163.06351	-3'642'661.21	-0.79
DAT029542	10.10.23	1'001'844'525	JPY	1.00	6'141'607.49	1.34
DAT029542	10.10.23	-5'500'000	GBP	181.93745	-6'134'321.33	-1.34
DAT029543	10.10.23	1'288'718'400	JPY	1.00	7'900'230.41	1.72
DAT029543	10.10.23	-15'000'000	NZD	89.56446	-8'235'854.96	-1.80
DAT029544	10.10.23	4'500'000	USD	1.00	4'116'600.00	0.90
DAT029544	10.10.23	-77'471'928	MXN	0.05748	-4'073'372.59	-0.89
DAT029547	10.10.23	1'289'972'250	JPY	1.00	7'907'916.88	1.71
DAT029547	10.10.23	-15'000'000	NZD	89.56446	-8'235'854.96	-1.80
DAT029548	10.10.23	1'500'000	USD	1.00	1'372'200.00	0.30
DAT029548	10.10.23	-25'784'806.5	MXN	0.05748	-1'355'731.39	-0.30
DAT029573	10.10.23	3'800'000	USD	1.00	3'476'240.00	0.76
DAT029573	10.10.23	-41'622'000.4	SEK	0.09207	-3'505'702.08	-0.76
DAT029582	10.10.23	600'000	EUR	1.00	581'130.00	0.13
DAT029582	10.10.23	-93'971'400	JPY	0.00633	-576'547.33	-0.13
DAT029591	10.10.23	1'300'000	USD	1.00	1'189'240.00	0.26
DAT029591	10.10.23	-1'716'170'300	KRW	0.00074	-1'164'107.91	-0.25

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
DAT029649	27.10.23	900'000	USD	1.00	823'320.00	0.18
DAT029649	27.10.23	-3'740'661	PLN	0.22899	-783'578.34	-0.17
DAT029658	10.10.23	220'180'200	JPY	1.00	1'349'770.68	0.29
DAT029658	10.10.23	-1'500'000	USD	149.06137	-1'370'686.38	-0.30
DAT029660	10.10.23	1'500'000	EUR	1.00	1'452'825.00	0.32
DAT029660	10.10.23	-236'420'400	JPY	0.00633	-1'450'521.67	-0.32
DAT029661	10.10.23	2'000'000	GBP	1.00	2'233'100.00	0.49
DAT029661	10.10.23	-368'986'420	JPY	0.0055	-2'264'469.39	-0.49
DAT029675	10.10.23	1'500'000	USD	1.00	1'372'200.00	0.30
DAT029675	10.10.23	-219'566'400	JPY	0.00671	-1'347'494.27	-0.29
DAT029697	27.10.23	91'034	JPY	1.00	558.07	0.00
DAT029697	27.10.23	-500	GBP	181.43256	-556.12	0.00
DAT029704	10.10.23	22'845'058	NOK	1.00	1'964'003.34	0.43
DAT029704	10.10.23	-2'000'000	EUR	11.26708	-1'937'274.60	-0.42
DAT029709	14.11.23	250'000'000	JPY	1.00	1'532'575.00	0.33
DAT029709	14.11.23	-1'521'047.5	CHF	162.7498	-1'517'556.81	-0.33
DAT029710	14.11.23	103'135'188	JPY	1.00	632'249.64	0.14
DAT029710	14.11.23	-1'200'000	NZD	89.04212	-655'025.89	-0.14
DAT029711	14.11.23	219'283'960	JPY	1.00	1'344'276.46	0.29
DAT029711	14.11.23	-1'400'000	EUR	157.18055	-1'348'989.51	-0.29
DAT029712	14.11.23	187'402'200	JPY	1.00	1'148'831.71	0.25
DAT029712	14.11.23	-2'000'000	AUD	95.79208	-1'174'468.42	-0.26
DAT029717	10.10.23	1'424'737.6	CHF	1.00	1'424'737.60	0.31
DAT029717	10.10.23	-1'600'000	USD	0.91413	-1'462'601.60	-0.32
DAT029720	14.11.23	5'199'091.8	PEN	1.00	1'254'303.25	0.27
DAT029720	14.11.23	-1'400'000	USD	3.80031	-1'283'576.76	-0.28
DAT029726	14.11.23	33'233'745	NOK	1.00	2'857'125.00	0.62
DAT029726	14.11.23	-2'500'000	GBP	12.97511	-2'788'695.82	-0.61
DAT029731	06.12.23	989'483'000	CLP	1.00	1'013'230.59	0.22
DAT029731	06.12.23	-1'100'000	USD	897.38871	-1'010'818.64	-0.22
DAT029735	14.11.23	2'500'000	GBP	1.00	2'791'375.00	0.61
DAT029735	14.11.23	-32'932'862.5	NOK	0.07707	-2'833'978.36	-0.62
DAT029736	14.11.23	449'933'500	JPY	1.00	2'758'227.34	0.60
DAT029736	14.11.23	-2'500'000	GBP	180.90095	-2'772'442.81	-0.60
DAT029739	14.11.23	2'458'817.2	CHF	1.00	2'458'817.20	0.54
DAT029739	14.11.23	-400'000'000	JPY	0.00614	-2'457'761.56	-0.54
DAT029755	14.11.23	295'695'200	JPY	1.00	1'812'700.28	0.40
DAT029755	14.11.23	-2'000'000	USD	148.18555	-1'816'843.80	-0.40
DAT029757	10.10.23	2'000'000	EUR	1.00	1'937'100.00	0.42
DAT029757	10.10.23	-22'600'136	NOK	0.08875	-1'942'772.14	-0.42
DAT029758	14.11.23	148'173'900	JPY	1.00	908'350.46	0.20
DAT029758	14.11.23	-1'000'000	USD	148.18555	-908'421.90	-0.20
Opérations à terme sur devises					-631'461.37	-0.14

ISIN	Désignation	Nombre/Nominal	Monnaie	Cours	Valeur vénale	en %
------	-------------	----------------	---------	-------	---------------	------

Valeurs mobilières évaluées selon un modèle

Obligations					0.03	0.00
RU000A0JU4L3	7 % Russia 13-23 Series 26215	120'000'000	RUB	0.00 %	0.01	0.00
RU000A0JWM07	7 3/4 % Russia 16-26	27'000'000	RUB	0.00 %	0.00	0.00
RU000A0ZYUA9	6.90 % Russia 18-29 Series 26224	60'000'000	RUB	0.00 %	0.01	0.00
RU000A100A82	7.65 % Russia 19-30 Series 26228	64'000'000	RUB	0.00 %	0.01	0.00
RU000A100EF5	7.70 % Russia 19-39 Series OFZ-26230-PD	15'000'000	RUB	0.00 %	0.00	0.00
RU000A100EG3	7.15 % Russia 19-25 Series OFZ-26229-PD	19'000'000	RUB	0.00 %	0.00	0.00
Russie					0.03	0.00

*Les contrats sur futures ouverts sont sans valeur vénale car le gain ou la perte est comptabilisée directement sur les avoirs en banque à vue.

Inventaire résumé	Valeur vénale	en %
Avoirs en banque à vue	10'116'833.70	2.21
Obligations, obligations convertibles, emprunts à option et autres titres de créance et droits-valeurs	445'102'927.85	97.13
Instruments financiers dérivés	-631'461.37	-0.14
Autres actifs	3'678'943.76	0.80
Fortune totale du fonds à la fin de la période comptable	458'267'243.94	100.00
Engagements envers les banques à court terme	-160'330.53	
Autres engagements	-43'208.16	
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	458'063'705.25	

Cours de change			
AUD	1 =	CHF	0.590412
CAD	1 =	CHF	0.676627
CLP	1 =	CHF	0.001024
CNY	1 =	CHF	0.125246
CZK	1 =	CHF	0.039767
DKK	100 =	CHF	12.98841
EUR	1 =	CHF	0.96855
GBP	1 =	CHF	1.11655
HKD	100 =	CHF	11.68051
HUF	100 =	CHF	0.24942
IDR	100 =	CHF	0.00592
ILS	1 =	CHF	0.240294
JPY	100 =	CHF	0.61303
KRW	100 =	CHF	0.06779
MXN	100 =	CHF	5.26398
MYR	100 =	CHF	19.48352
NOK	100 =	CHF	8.59706
NZD	1 =	CHF	0.549658

PEN	1 = CHF	0.241254
PLN	100 = CHF	20.95738
RON	1 = CHF	0.194721
RUB	1 = CHF	0.009373
SEK	100 = CHF	8.42032
SGD	100 = CHF	67.02323
THB	100 = CHF	2.51232
USD	1 = CHF	0.9148

Risques sur instruments financiers dérivés selon l'approche Commitment II

Engagement du fonds	% de la fortune nette	Montant
Engagement total brut résultant de dérivés	49%	226'454'212.97
Engagement total net résultant de dérivés	23%	105'770'122.15
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		0.00
Type et montant des sûretés acceptées		
Aucune sûreté acceptée		0.00
Contreparties pour les opérations over-the-counter (OTC)		
- Banque Cantonale Vaudoise		

Liste des transactions pendant la période comptable

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
Positions ouvertes à la fin de la période comptable			
Obligations			
AT0000A0U299	3.80 % Oesterreich 12-62	0	85'000
AT0000A1FAP5	1.20 % Oesterreich 15-25	0	420'000
AT0000A1K9F1	1 1/2 % Oesterreich 16-47	0	320'000
AT0000A1VGK0	1/2 % Oesterreich 17-27	0	210'000
AT0000A2EJ08	3/4 % Oesterreich 20-51	285'000	0
AT0000A2KQ43	0 % Oesterreich 20-40 NT	400'000	0
AT0000A2NW83	0 % Oesterreich 21-31	300'000	0
AT0000A2WSC8	0.90 % Oesterreich 22-32	700'000	530'000
AT0000A33SK7	3.15 % Oesterreich 23-53	300'000	200'000
AU0000013740	2 1/2 % Australia 18-30 NT	0	1'300'000
AU000XCLWAG2	4 1/2 % Australia 13-33 Series 140 TB	1'600'000	740'000
AU000XCLWAR9	2 1/4 % Australia 16-28 NT	2'000'000	1'300'000
AU3TB0000168	3 1/4 % Australia 13-25 NT Series 139 TB	0	1'300'000
BE0000320292	4 1/4 % Belgique 10-41 Unitary 60 OLO	117'000	0
BE0000326356	4 % Belgique 12-32 Unitary 66 OLO	868'000	0
BE0000348574	1.70 % Belgique 19-50 Unitary 88 OLO	150'000	0
BE0000354630	0.35 % Belgique 22-32 Unitary 94 OLO	600'000	630'000
CA135087H722	2 % Canada 17-51 Series H722 TB	0	320'000
CA135087M276	1 1/2 % Canada 21-31 TB	1'100'000	1'000'000
CA135087M680	1 3/4 % Canada 21-53 TB	200'000	0
CA135087M920	3/4 % Canada 20-24 TB	0	2'800'000
CA135087Q236	2 3/4 % Canada 23-33 TB	3'300'000	1'240'000
CA135087XG49	5 3/4 % Canada 01-33 Series XG49 TB	400'000	0
CND10002D1Y9	3.86 % Republique Populaire de Chine 19-49 NT	0	12'000'000
CND10003R702	3.02 % Republique Populaire de Chine 20-25 NT	40'000'000	19'000'000
CND10004TCP5	3.32 % Republique Populaire de Chine 22-52 NT	17'000'000	7'900'000
CND10005F4L5	2 1/2 % Republique Populaire de Chine 22-27 NT	20'000'000	0
CND10005L4G7	2.60 % Republique Populaire de Chine 22-32 NT	39'000'000	16'000'000
CZ0001002547	5.70 % Czech Republic 09-24 Series 58	0	12'300'000
CZ0001004477	0.95 % Czech Republic 15-30 Series 94	12'500'000	0
CZ0001005243	2 % Czech Republic 17-33 Series 103	17'700'000	0
DE0001102374	1/2 % Deutschland 15-25	0	320'000
DE0001102390	1/2 % Deutschland 16-26	0	2'200'000
DE0001102432	1 1/4 % Deutschland 17-48	0	420'000
DE0001102440	1/2 % Deutschland 18-28	10'000'000	3'700'000
DE0001102614	1.80 % Deutschland 22-53	8'600'000	5'430'000
DE0001135432	3 1/4 % Deutschland 10-42	0	850'000
DE0001135481	2 1/2 % Deutschland 12-44	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

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
DE000BU2Z007	2.30 % Deutschland 23-33	28'400'000	22'400'000
DK0009923807	1/2 % Denmark 19-29 TB	2'800'000	2'100'000
DK0009924532	2 /14 % Denmark 23-33 TB	3'300'000	2'100'000
ES00000121S7	4.70 % Espana 09-41 BS	200'000	0
ES00000126Z1	1.60 % Espana 15-25 BS	0	1'158'000
ES0000012E51	1.45 % Espana 19-29 BS	0	740'000
ES0000012G00	1 % Espana 20-50 BS	0	420'000
ES0000012I32	1/2 % Espana 21-31 BS	400'000	0
ES0000012K46	1.90 % Espana 22-52 BS	500'000	270'000
ES0000012K61	2.55 % Espana 22-32 BS	1'600'000	1'200'000
FI4000148630	3/4 % Finland 15-31 TB	500'000	950'000
FI4000480488	1/8 % Finland 21-52 TB	300'000	0
FR0000187635	5 3/4 % France 01-32 OAT	800'000	1'433'000
FR0010773192	4 1/2 % France 09-41 OAT	200'000	0
FR0011461037	3 1/4 % France 13-45 OAT	0	880'000
FR0011619436	2 1/4 % France 13-24 OAT	0	2'200'000
FR0012938116	1 % France 15-25 OAT	2'400'000	1'700'000
FR0012993103	1 1/2 % France 15-31 OAT	1'100'000	0
FR0013286192	3/4 % France 17-28 OAT	200'000	1'300'000
FR0013480613	3/4 % France 19-52 OAT	900'000	460'000
FR001400CMX2	2 1/2 % France 22-43 OAT	300'000	0
GB00B1VWPJ53	4 1/2 % United Kingdom 07-42 TB	1'600'000	1'600'000
GB00B6RNH572	3 3/4 % United Kingdom 11-52 TB	12'900'000	13'500'000
GB00BDRHNP05	1 1/4 % United Kingdom 17-27 TB	0	3'500'000
GB00BFX0ZL78	1 5/8 % United Kingdom 18-28 TB	2'307'000	1'125'000
GB00BM8Z2T38	1 % United Kingdom 21-32 TB	2'700'000	3'100'000
GB00BMV7TC88	3 1/4 % United Kingdom 23-33 TB	3'900'000	1'900'000
GB00BPCJD997	3 3/4 % United Kingdom 23-53	8'700'000	8'200'000
GB00BTHH2R79	2 % United Kingdom 15-25 TB	10'000'000	6'600'000
IDG000012006	8 3/8 % Indonesia 13-24 Series FR0070	0	17'000'000'000
IDG000018300	6.875 % Indonesia 21-51 Series FR0089	12'000'000'000	0
IDG000018706	6 3/8 % Indonesia 21-32 Series FR0091	0	15'000'000'000
IE00BH3SQ895	1.10 % Ireland 19-29 TB	750'000	0
IE00BMQ5JM72	0.55 % Ireland 21-41 TB	400'000	0
IL0011508798	2 1/4 % Israel 18-28 Classe SHA	2'400'000	2'100'000
IL0011806606	1.30 % Israel 21-32	1'700'000	1'600'000
IT0005162828	2.70 % Italia 16-47 BT	0	900'000
IT0005425233	1.70 % Italia 20-51 BT	200'000	0
IT0005433690	1/4 % Italia 21-28 BT	2'200'000	1'400'000
IT0005466013	0.95 % Italia 21-32 BT	3'800'000	2'300'000
JP1103361EC6	1/2 % Japan 14-24 No 336	0	110'000'000
JP1103701P43	1/2 % Japan 23-33 Series 370 TB	850'000'000	370'000'000

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

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

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
JP1201231AC0	2.10 % Japan 10-30 No 123	0	250'000'000
JP1201411CC4	1.70 % Japan 12-32 No 141	0	250'000'000
JP1300371C98	1.90 % Japan 12-42 No 37	310'000'000	325'000'000
JP1400051C51	2 % Japan 12-52 Series 5 TB	340'000'000	290'000'000
KR103501GD32	3 1/4 % Republique de Coree 23-28 Series 03250-2803(23-1)	1'400'000'000	0
KR103502G4C9	2 3/4 % Republique de Coree 14-44 Series 02750-4412 (14-7)	1'300'000'000	0
KR103502GB66	2 % Republique de Coree 21-31 Series 02000-3106 (21-5)	500'000'000	0
KR103502GD31	3 1/4 % Republique de Coree 23-53 Series 03250-5303 (23-2)	1'550'000'000	0
MX0MGO000078	10 % Mexico 05-24 Series M BS	0	180'000
MX0MGO0001D6	7 1/2 % Mexico 22-33 BS	440'000	0
MYBMO2200016	3.582 % Malaysia 22-32 Series 22/0001 NT	0	8'000'000
MYBMT1800039	4.642 % Malaysia 18-33 Series 18/0003 NT	7'000'000	0
NL0009446418	3 3/4 % Niederlande 10-42	800'000	490'000
NL0010071189	2 1/2 % Niederlande 12-33	300'000	0
NL0015000RP1	1/2 % Niederlande 20-32	600'000	850'000
NL0015614579	0 % Niederlande 20-52	600'000	1'100'000
NZGOVDT433C9	3 1/2 % New Zealand 15-33 NT	7'200'000	420'000
NZGOVDT541C9	1 3/4 % New Zealand 20-41 NT	0	210'000
PL0000112736	1 1/4 % Poland 20-30 Series DS1030	2'000'000	0
PL0000115291	6 % Poland 22-33 Series DS1033	3'300'000	0
PTOTENOEO0034	0.90 % Republique Portugaise 20-35 BT	400'000	530'000
PTOTEEOEO0033	0.30 % Republique Portugaise 21-31 BT	200'000	0
PTOTEPOEO0032	1.15 % Republique Portugaise 22-42 BT	300'000	0
PTOTEVOEO0018	2 1/8 % Republique Portugaise 18-28 BT	0	750'000
SE0004517290	2 1/4 % Sverige 12-32 Series 1056 TB	57'000'000	11'500'000
SG7U32949426	2 7/8 % Singapore 10-30 NT	0	1'200'000
SGXF27246101	1 7/8 % Singapore 20-50 TB	300'000	0
SGXF46767848	2 5/8 % Singapore 22-32 TB	250'000	0
TH0623035C07	3.85 % Thailand 10-25 NT	0	5'300'000
US912810QW18	3 % USA 12-42 TB	2'850'000	2'850'000
US912810TD00	2 1/4 % USA 22-52 Series 2052 TB	200'000	0
US912810TF57	2 3/8 % USA 22-42 TB	1'700'000	1'150'000
US912810TJ79	3 % USA 22-52 TB	3'850'000	3'150'000
US9128282A70	1 1/2 % USA 26 16-26 Series E-2026 TB	0	4'200'000
US912828M565	2 1/4 % USA 15-25 Series F-2025 TB	0	3'000'000
US912828XT22	2 % USA 17-24 Series L-2024 TB	4'000'000	7'750'000
US91282CCE93	1 1/4 % USA 21-28 Series L-2028 TB	18'500'000	6'100'000
US91282CGM73	3 1/2 % USA 23-33 TB	29'750'000	21'750'000

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

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

ISIN	Désignation	Achats 1)	Ventes 2)
------	-------------	-----------	-----------

Positions fermées en cours de période comptable

Obligations

AT0000A105W3	1 3/4 % Oesterreich 13-23	0	800'000
AT0000A1PE50	0 % Oesterreich 16-23	0	230'000
BE0000332412	2.60 % Belgique 14-24 Unitary 72 OLO	0	1'000'000
BE0000345547	0.80 % Belgique 18-28 Unitary 85 OLO	0	300'000
BE0000359688	3.45 % Belgique 23-43 Unitary 99 OLO	400'000	400'000
CND100025LFO	3.19 % Republique Populaire de Chine 19-24 NT	0	22'500'000
DE0001102572	0 % Deutschland 21-52	2'500'000	5'000'000
ES0000012K95	3.45 % Espana 22-43 BS	400'000	400'000
GB00BM8Z2S21	7/8 % United Kingdom 21-33 TB	11'500'000	12'400'000
IL0011267478	4 1/4 % Israel 12-23	0	1'100'000
JP1103421G35	0.10 % Japan 16-26 No 342	0	600'000'000
JP1103471H66	0.10 % Japan 17-27 No 347	0	1'000'000'000
KR103502GCC8	4 1/4 % Republique de Coree 22-32 Series 04250-3212 (22-14)	4'000'000'000	4'000'000'000
US91282CAJ09	1/4 % USA 20-25 Series AC-2025 TB	2'800'000	3'400'000
US91282CCS89	1 1/4 % USA 21-31 Series E-2031 TB	0	6'500'000
US91282CFF32	2 3/4 USA 22-32 Series E-2032 TB	0	3'200'000

Code instrument	Désignation	Echéance	Change	Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes
-----------------	-------------	----------	--------	---------	--------	---------	--------

Positions ouvertes à la fin de la période comptable

Opérations à terme sur devises

DAT029536	10.10.23	157.73526	JPY	189'282'312.00	EUR	1'200'000.00
DAT029537	10.10.23	164.41500	JPY	1'200'000'000.00	CHF	7'298'604.00
DAT029538	10.10.23	142.50925	JPY	213'763'875.00	USD	1'500'000.00
DAT029540	10.10.23	157.63820	JPY	1'261'105'600.00	EUR	8'000'000.00
DAT029541	10.10.23	164.65350	JPY	600'000'000.00	CHF	3'644'016.00
DAT029542	10.10.23	182.15355	JPY	1'001'844'525.00	GBP	5'500'000.00
DAT029543	10.10.23	85.91456	JPY	1'288'718'400.00	NZD	15'000'000.00
DAT029544	10.10.23	0.05809	USD	4'500'000.00	MXN	77'471'928.00
DAT029547	10.10.23	85.99815	JPY	1'289'972'250.00	NZD	15'000'000.00
DAT029548	10.10.23	0.05817	USD	1'500'000.00	MXN	25'784'806.50
DAT029573	10.10.23	0.09130	USD	3'800'000.00	SEK	41'622'000.40
DAT029582	10.10.23	0.00638	EUR	600'000.00	JPY	93'971'400.00
DAT029591	10.10.23	0.00076	USD	1'300'000.00	KRW	1'716'170'300.00

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

Code instrument	Désignation	Echéance	Change	Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes
DAT029649		27.10.23	0.24060	USD	900'000.00	PLN	3'740'661.00
DAT029658		10.10.23	146.78680	JPY	220'180'200.00	USD	1'500'000.00
DAT029660		10.10.23	0.00634	EUR	1'500'000.00	JPY	236'420'400.00
DAT029661		10.10.23	0.00542	GBP	2'000'000.00	JPY	368'986'420.00
DAT029675		10.10.23	0.00683	USD	1'500'000.00	JPY	219'566'400.00
DAT029697		27.10.23	182.06800	JPY	91'034.00	GBP	500.00
DAT029704		10.10.23	11.42253	NOK	22'845'058.00	EUR	2'000'000.00
DAT029709		14.11.23	164.36042	JPY	250'000'000.00	CHF	1'521'047.50
DAT029710		14.11.23	85.94599	JPY	103'135'188.00	NZD	1'200'000.00
DAT029711		14.11.23	156.63140	JPY	219'283'960.00	EUR	1'400'000.00
DAT029712		14.11.23	93.70110	JPY	187'402'200.00	AUD	2'000'000.00
DAT029717		10.10.23	0.89046	CHF	1'424'737.60	USD	1'600'000.00
DAT029720		14.11.23	3.71364	PEN	5'199'091.80	USD	1'400'000.00
DAT029726		14.11.23	13.29350	NOK	33'233'745.00	GBP	2'500'000.00
DAT029731		06.12.23	899.53000	CLP	989'483'000.00	USD	1'100'000.00
DAT029735		14.11.23	0.07591	GBP	2'500'000.00	NOK	32'932'862.50
DAT029736		14.11.23	179.97340	JPY	449'933'500.00	GBP	2'500'000.00
DAT029739		14.11.23	0.00615	CHF	2'458'817.20	JPY	400'000'000.00
DAT029755		14.11.23	147.84760	JPY	295'695'200.00	USD	2'000'000.00
DAT029757		10.10.23	0.08850	EUR	2'000'000.00	NOK	22'600'136.00
DAT029758		14.11.23	148.17390	JPY	148'173'900.00	USD	1'000'000.00

Futures

CBOT.UL11223	US ULTRABOND 10 YEAR	31.12.23			290.00		50.00
EURX.BD1223	EUREX EURO BUND	31.12.23			460.00		110.00

Positions fermées en cours de période comptable

Opérations à terme sur devises

DAT029000		11.05.23	0.09720	USD	2'500'000.00	NOK	25'719'530.00
DAT029001		14.04.23	1.00760	SEK	1'309'878.70	NOK	1'300'000.00
DAT029006		11.05.23	0.09693	USD	2'500'000.00	SEK	25'792'517.50
DAT029007		11.05.23	131.37670	JPY	656'883'500.00	USD	5'000'000.00
DAT029016		11.05.23	0.00691	CHF	2'072'801.40	JPY	300'000'000.00
DAT029029		11.05.23	0.00763	USD	5'000'000.00	JPY	655'507'500.00
DAT029039		13.06.23	1.00687	NOK	85'000'000.00	SEK	84'419'994.00
DAT029040		15.06.23	0.00077	USD	2'000'000.00	KRW	2'599'620'000.00
DAT029043		14.06.23	149.20538	JPY	200'000'000.00	CHF	1'340'434.20
DAT029045		14.06.23	149.78513	JPY	600'000'000.00	CHF	4'005'738.00
DAT029046		14.06.23	149.72660	JPY	600'000'000.00	CHF	4'007'304.00

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

Code instrument	Désignation	Echéance	Change	Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes
DAT029080		11.05.23	0.00670	CHF	2'010'174.00	JPY	300'000'000.00
DAT029083		11.05.23	0.00668	CHF	668'418.00	JPY	100'000'000.00
DAT029086		28.06.23	4'620.51000	COP	6'468'714'000.00	USD	1'400'000.00
DAT029088		11.05.23	170.71310	JPY	426'782'750.00	GBP	2'500'000.00
DAT029089		11.05.23	152.82084	JPY	150'000'000.00	CHF	981'541.50
DAT029091		13.06.23	1.04118	NOK	30'000'000.00	SEK	28'813'500.00
DAT029095		11.05.23	83.90710	JPY	335'628'400.00	NZD	4'000'000.00
DAT029099		11.05.23	151.68591	JPY	300'000'000.00	CHF	1'977'771.00
DAT029100		11.05.23	135.83340	JPY	339'583'500.00	USD	2'500'000.00
DAT029103		13.06.23	1.04791	NOK	30'000'000.00	SEK	28'628'400.00
DAT029104		11.05.23	0.00587	GBP	2'500'000.00	JPY	425'545'000.00
DAT029114		11.05.23	0.00656	CHF	983'896.50	JPY	150'000'000.00
DAT029116		11.05.23	0.00737	USD	2'500'000.00	JPY	339'035'000.00
DAT029117		15.06.23	10.66169	NOK	26'654'227.50	USD	2'500'000.00
DAT029120		13.06.23	0.95637	SEK	28'690'950.00	NOK	30'000'000.00
DAT029121		11.05.23	0.00660	CHF	1'979'679.00	JPY	300'000'000.00
DAT029124		15.06.23	0.09410	USD	2'500'000.00	NOK	26'566'610.00
DAT029131		13.06.23	0.96665	SEK	19'332'980.00	NOK	20'000'000.00
DAT029132		14.06.23	147.41573	JPY	515'955'055.00	EUR	3'500'000.00
DAT029134		14.06.23	84.93520	JPY	2'038'444'800.00	NZD	24'000'000.00
DAT029135		14.06.23	169.49771	JPY	423'744'275.00	GBP	2'500'000.00
DAT029136		14.06.23	134.31842	JPY	805'910'520.00	USD	6'000'000.00
DAT029137		14.06.23	0.93484	AUD	8'000'000.00	NZD	8'557'592.00
DAT029144		14.06.23	0.00680	EUR	600'000.00	JPY	88'248'540.00
DAT029145		13.06.23	0.96933	SEK	9'693'330.00	NOK	10'000'000.00
DAT029153		14.06.23	0.00664	CHF	663'854.00	JPY	100'000'000.00
DAT029154		14.06.23	0.01185	NZD	2'000'000.00	JPY	168'801'600.00
DAT029155		14.06.23	0.00666	CHF	666'466.00	JPY	100'000'000.00
DAT029156		13.06.23	1.03368	NOK	16'000'000.00	SEK	15'478'752.00
DAT029157		14.06.23	1.61009	NZD	4'500'000.00	USD	2'794'873.50
DAT029158		14.06.23	10.64677	NOK	59'621'912.00	USD	5'600'000.00
DAT029159		14.06.23	0.05645	USD	5'300'000.00	MXN	93'882'461.60
DAT029160		14.06.23	0.09389	USD	2'800'000.00	NOK	29'823'116.40
DAT029161		14.06.23	0.62538	USD	5'628'375.00	NZD	9'000'000.00
DAT029162		14.06.23	1.07387	NZD	4'295'488.00	AUD	4'000'000.00
DAT029163		13.06.23	0.97257	SEK	15'561'088.00	NOK	16'000'000.00
DAT029167		14.06.23	151.45985	JPY	100'000'000.00	CHF	660'241.00
DAT029168		14.06.23	84.20660	JPY	168'413'200.00	NZD	2'000'000.00
DAT029169		14.06.23	151.89258	JPY	100'000'000.00	CHF	658'360.00
DAT029170		14.06.23	1.07703	NZD	4'308'132.00	AUD	4'000'000.00

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

Code instrument	Désignation	Echéance	Change	Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes
DAT029175		13.07.23	806.38000	CLP	1'128'932'000.00	USD	1'400'000.00
DAT029176		14.06.23	152.62005	JPY	200'000'000.00	CHF	1'310'443.80
DAT029177		13.06.23	1.03327	NOK	38'000'000.00	SEK	36'776'362.00
DAT029178		14.06.23	0.62365	USD	1'621'484.80	NZD	2'600'000.00
DAT029179		14.06.23	85.34420	JPY	170'688'400.00	NZD	2'000'000.00
DAT029180		14.06.23	152.19264	JPY	200'000'000.00	CHF	1'314'124.00
DAT029181		13.07.23	3.70408	PEN	4'444'900.80	USD	1'200'000.00
DAT029186		13.06.23	0.97165	SEK	14'574'795.00	NOK	15'000'000.00
DAT029190		13.06.23	0.96888	SEK	14'533'245.00	NOK	15'000'000.00
DAT029191		14.06.23	0.94339	AUD	4'000'000.00	NZD	4'240'024.00
DAT029192		14.06.23	1.14853	EUR	2'200'000.00	GBP	1'915'494.24
DAT029207		14.06.23	1.07021	NZD	4'280'836.00	AUD	4'000'000.00
DAT029208		14.06.23	0.01179	NZD	1'000'000.00	JPY	84'784'400.00
DAT029209		14.06.23	0.01182	NZD	1'000'000.00	JPY	84'582'900.00
DAT029212		20.07.23	13.55319	NOK	33'882'965.00	GBP	2'500'000.00
DAT029213		20.07.23	6.66945	NOK	26'677'796.00	NZD	4'000'000.00
DAT029215		14.06.23	0.01185	NZD	2'000'000.00	JPY	168'718'800.00
DAT029220		14.06.23	84.56130	JPY	169'122'600.00	NZD	2'000'000.00
DAT029226		14.06.23	0.01185	NZD	2'000'000.00	JPY	168'729'600.00
DAT029239		20.07.23	0.14984	NZD	4'000'000.00	NOK	26'695'936.00
DAT029240		13.06.23	0.97671	SEK	10'743'755.00	NOK	11'000'000.00
DAT029242		31.07.23	0.08969	USD	2'700'000.00	NOK	30'102'019.20
DAT029243		14.06.23	0.01195	NZD	1'500'000.00	JPY	125'544'450.00
DAT029245		31.07.23	11.21292	NOK	30'274'886.70	USD	2'700'000.00
DAT029246		31.07.23	1'321.18090	KRW	1'056'944'720.00	USD	800'000.00
DAT029248		13.06.23	1.02550	NOK	11'000'000.00	SEK	10'726'485.00
DAT029249		20.07.23	6.71000	NOK	26'839'988.00	NZD	4'000'000.00
DAT029250		13.06.23	0.97798	SEK	10'757'736.00	NOK	11'000'000.00
DAT029251		31.07.23	0.74446	USD	1'300'000.00	CAD	1'746'221.10
DAT029257		20.07.23	0.14985	NZD	4'000'000.00	NOK	26'693'680.00
DAT029259		13.06.23	1.02635	NOK	11'000'000.00	SEK	10'717'575.00
DAT029260		13.06.23	0.97760	SEK	10'753'628.60	NOK	11'000'000.00
DAT029270		13.06.23	0.99020	SEK	10'892'178.00	NOK	11'000'000.00
DAT029277		14.08.23	1.00030	NOK	80'000'000.00	SEK	79'976'080.00
DAT029279		14.08.23	174.39830	JPY	435'995'750.00	GBP	2'500'000.00
DAT029280		14.08.23	1.00218	SEK	10'021'790.00	NOK	10'000'000.00
DAT029281		14.08.23	153.78346	JPY	1'900'000'000.00	CHF	12'355'035.00
DAT029282		14.08.23	0.61424	USD	4'361'086.96	NZD	7'100'000.00
DAT029283		14.08.23	0.05718	USD	5'300'000.00	MXN	92'682'107.00
DAT029284		14.08.23	84.98110	JPY	1'869'584'200.00	NZD	22'000'000.00

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

Code instrument	Désignation	Echéance	Change	Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes
DAT029285		14.08.23	1.00505	SEK	10'050'542.00	NOK	10'000'000.00
DAT029293		14.08.23	1.00699	SEK	15'104'871.00	NOK	15'000'000.00
DAT029294		14.08.23	175.41599	JPY	438'539'975.00	GBP	2'500'000.00
DAT029295		14.08.23	10.50411	NOK	10'504'111.00	USD	1'000'000.00
DAT029296		14.08.23	1.01144	SEK	15'171'624.00	NOK	15'000'000.00
DAT029297		14.08.23	1.01283	SEK	15'192'393.00	NOK	15'000'000.00
DAT029298		14.08.23	138.14946	JPY	828'896'760.00	USD	6'000'000.00
DAT029299		14.08.23	0.99452	NOK	15'000'000.00	SEK	15'082'647.00
DAT029306		14.08.23	0.00079	USD	1'200'000.00	KRW	1'523'995'200.00
DAT029307		14.08.23	177.63591	JPY	355'271'820.00	GBP	2'000'000.00
DAT029311		14.08.23	157.97327	JPY	300'000'000.00	CHF	1'899'055.50
DAT029312		14.08.23	6.55260	NOK	22'934'093.00	NZD	3'500'000.00
DAT029313		14.08.23	6.53685	NOK	22'878'971.50	NZD	3'500'000.00
DAT029314		14.08.23	140.39881	JPY	280'797'620.00	USD	2'000'000.00
DAT029317		14.08.23	1.16840	EUR	2'700'000.00	GBP	2'310'849.00
DAT029318		14.08.23	13.62735	NOK	34'068'375.00	GBP	2'500'000.00
DAT029322		14.08.23	0.00712	USD	1'000'000.00	JPY	140'498'000.00
DAT029323		14.08.23	0.85744	GBP	2'315'074.50	EUR	2'700'000.00
DAT029343		14.08.23	0.97736	CHF	6'841'513.00	EUR	7'000'000.00
DAT029344		14.08.23	1.13497	CHF	2'269'934.00	GBP	2'000'000.00
DAT029345		14.08.23	154.70060	JPY	154'700'600.00	EUR	1'000'000.00
DAT029346		14.08.23	1.00730	SEK	15'109'470.00	NOK	15'000'000.00
DAT029347		14.08.23	140.95520	JPY	140'955'200.00	USD	1'000'000.00
DAT029348		14.08.23	0.00711	USD	1'000'000.00	JPY	140'698'100.00
DAT029349		14.08.23	0.07362	GBP	2'500'000.00	NOK	33'956'785.00
DAT029350		14.08.23	158.04255	JPY	700'000'000.00	CHF	4'429'187.00
DAT029353		14.08.23	1.01112	NOK	25'000'000.00	SEK	24'725'125.00
DAT029354		14.08.23	13.76488	NOK	34'412'195.00	GBP	2'500'000.00
DAT029355		14.08.23	87.47740	JPY	174'954'800.00	NZD	2'000'000.00
DAT029357		14.08.23	0.99192	SEK	24'798'100.00	NOK	25'000'000.00
DAT029359		14.08.23	0.07338	GBP	2'500'000.00	NOK	34'067'255.00
DAT029360		14.08.23	88.24429	JPY	88'244'290.00	NZD	1'000'000.00
DAT029361		14.08.23	88.14680	JPY	88'146'800.00	NZD	1'000'000.00
DAT029362		14.08.23	1.00610	NOK	30'000'000.00	SEK	29'817'990.00
DAT029368		14.08.23	0.01146	NZD	2'500'000.00	JPY	218'076'250.00
DAT029369		14.08.23	0.15269	NZD	2'500'000.00	NOK	16'372'710.00
DAT029370		14.08.23	0.99803	SEK	29'940'840.00	NOK	30'000'000.00
DAT029371		14.08.23	4'234.22100	COP	5'927'909'400.00	USD	1'400'000.00
DAT029376		14.08.23	156.89960	JPY	156'899'600.00	EUR	1'000'000.00
DAT029377		14.08.23	87.92650	JPY	87'926'500.00	NZD	1'000'000.00

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

Code instrument	Désignation	Echéance	Change	Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes
DAT029378		14.08.23	182.49355	JPY	291'989'680.00	GBP	1'600'000.00
DAT029379		14.08.23	0.89066	CHF	1'335'990.00	USD	1'500'000.00
DAT029396		14.08.23	0.09255	USD	2'500'000.00	SEK	27'011'215.00
DAT029398		14.08.23	0.07390	GBP	500'000.00	NOK	6'765'688.00
DAT029399		14.08.23	88.90780	JPY	177'815'600.00	NZD	2'000'000.00
DAT029408		14.08.23	0.01133	NZD	1'000'000.00	JPY	88'259'700.00
DAT029409		14.08.23	0.01129	NZD	1'000'000.00	JPY	88'554'300.00
DAT029425		14.08.23	0.00703	USD	2'000'000.00	JPY	284'695'200.00
DAT029426		14.08.23	0.00077	USD	500'000.00	KRW	652'044'500.00
DAT029428		14.08.23	0.07416	GBP	2'500'000.00	NOK	33'711'255.00
DAT029429		14.08.23	181.83410	JPY	363'668'200.00	GBP	2'000'000.00
DAT029430		14.08.23	0.00551	GBP	2'000'000.00	JPY	362'897'600.00
DAT029432		14.08.23	0.07469	GBP	1'000'000.00	NOK	13'387'804.00
DAT029433		14.08.23	0.01149	NZD	1'000'000.00	JPY	87'061'700.00
DAT029434		14.08.23	0.07424	GBP	500'000.00	NOK	6'734'937.00
DAT029435		14.08.23	0.01157	NZD	1'000'000.00	JPY	86'459'600.00
DAT029436		14.09.23	0.00078	USD	1'800'000.00	KRW	2'321'803'980.00
DAT029444		14.08.23	0.07548	GBP	3'000'000.00	NOK	39'743'274.00
DAT029445		14.09.23	1.48225	AUD	5'000'000.00	USD	3'373'240.00
DAT029446		14.09.23	0.67849	USD	3'392'460.00	AUD	5'000'000.00
DAT029456		14.09.23	86.91960	JPY	173'839'200.00	NZD	2'000'000.00
DAT029457		14.09.23	160.38904	JPY	150'000'000.00	CHF	935'226.00
DAT029458		14.09.23	159.65591	JPY	150'000'000.00	CHF	939'520.50
DAT029460		14.09.23	0.00646	EUR	3'000'000.00	JPY	464'421'180.00
DAT029462		14.09.23	155.21100	JPY	155'211'000.00	EUR	1'000'000.00
DAT029463		14.09.23	0.01151	NZD	2'000'000.00	JPY	173'790'000.00
DAT029464		14.09.23	826.38600	CLP	1'156'940'400.00	USD	1'400'000.00
DAT029471		14.09.23	0.00620	CHF	1'861'485.00	JPY	300'000'000.00
DAT029472		14.08.23	0.00726	USD	1'200'000.00	JPY	165'347'400.00
DAT029474		14.09.23	0.00647	EUR	1'000'000.00	JPY	154'588'800.00
DAT029475		14.09.23	0.01165	NZD	1'000'000.00	JPY	85'836'900.00
DAT029476		14.08.23	13.19271	NOK	7'915'623.60	GBP	600'000.00
DAT029477		14.09.23	0.01160	NZD	1'000'000.00	JPY	86'170'300.00
DAT029482		14.08.23	12.92515	NOK	32'312'872.50	GBP	2'500'000.00
DAT029483		14.09.23	0.01157	NZD	800'000.00	JPY	69'144'880.00
DAT029484		14.09.23	155.39840	JPY	155'398'400.00	EUR	1'000'000.00
DAT029485		14.09.23	87.01790	JPY	174'035'800.00	NZD	2'000'000.00
DAT029486		31.07.23	1.31757	CAD	1'712'843.60	USD	1'300'000.00
DAT029487		14.08.23	0.90082	GBP	2'000'000.00	CHF	2'220'202.00
DAT029488		14.08.23	0.07739	GBP	1'300'000.00	NOK	16'798'072.20

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

Code instrument	Désignation	Echéance	Change	Monnaie	Achats	Monnaie	Ventes
DAT029496		14.08.23	0.01146	NZD	2'000'000.00	JPY	174'517'660.00
DAT029500		31.07.23	0.00078	USD	800'000.00	KRW	1'023'503'120.00
DAT029501		14.09.23	4'033.10700	COP	1'613'242'800.00	USD	400'000.00
DAT029502		14.09.23	0.00078	USD	1'200'000.00	KRW	1'530'258'240.00
DAT029504		14.09.23	3.61236	PEN	5'779'777.60	USD	1'600'000.00
DAT029511		14.09.23	85.85610	JPY	171'712'200.00	NZD	2'000'000.00
DAT029512		14.08.23	1.15487	USD	1'500'000.00	CHF	1'298'850.00
DAT029515		14.09.23	156.41710	JPY	187'700'520.00	EUR	1'200'000.00
DAT029526		14.09.23	0.00644	EUR	600'000.00	JPY	93'223'260.00
DAT029528		14.09.23	0.00640	EUR	2'000'000.00	JPY	312'425'400.00
DAT029531		14.09.23	162.61538	JPY	300'000'000.00	CHF	1'844'844.00
DAT029532		14.09.23	156.02010	JPY	624'080'400.00	EUR	4'000'000.00
DAT029549		14.09.23	4'066.29400	COP	5'286'182'200.00	USD	1'300'000.00
DAT029571		14.09.23	0.00607	CHF	606'698.00	JPY	100'000'000.00

Futures

CBOT.TN20623	US T-NOTES 2 Y	30.06.23			250.00		260.00
CBOT.TN20923	US T-NOTES 2 Y	30.09.23			2'100.00		2'100.00
CBOT.TN50923	US T-NOTES 5 Y	30.09.23			1'500.00		1'500.00
CBOT.UL10923	US ULTRABOND 10 YEAR	30.09.23			520.00		520.00
EURO.SH0623	EURO SCHATZ EUREX	30.06.23			625.00		625.00
EURO.SH0923	EURO SCHATZ EUREX	30.09.23			2'910.00		2'910.00
EURX.BD0623	EUREX EURO BUND	30.06.23			235.00		235.00
EURX.BD0923	EUREX EURO BUND	30.09.23			1'270.00		1'270.00
EURX.BOB0923	EURO-BOBL	30.09.23			650.00		650.00
LIF.LG0923	LONG GILT	30.09.23			450.00		450.00
LIF.LG1223	LONG GILT	31.12.23			130.00		130.00

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

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

Notes aux états financiers

Commissions

AMC PROFESSIONAL FUND – BCV Fiscal Strength Government Bonds	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 B	0.40%*	Max. 1.75%	Max. 0.80%	
Classe C	0.30%*			
Classe Z	0.09%*			

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

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

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

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

Calcul et évaluation de la valeur nette d'inventaire

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

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

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

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

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

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

Rapport de performance

		2020	2021	2022	2023 au 30 sept.
Performance :					
– Classe B (lancée le 06.09.17)	%	0.70	-3.57	-16.56	-5.15
– Classe C (lancée le 14.06.17)	%	0.79	-3.47	-16.47	-5.06
– Classe Z (lancée le 14.06.17)	%	1.01	-3.27	-16.30	-4.93

Notes

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