



Portfolio Management

Mandant

Rapport financier

31.12.2012

Monnaie de référence CHF

Introduction.....	3
Bilan.....	4
Compte d'exploitation.....	7
Inventaire des titres.....	11
Journal des comptes.....	16
Journal des titres.....	20
Journal des transactions.....	23
Cours change historiques.....	26

Ce rapport financier a été réalisé pour un client fictif que nous appelons "Mandant". Ce client suisse, donc avec le franc suisse comme monnaie de base, possède plusieurs portefeuilles dans diverses banques de dépôt. Il s'agit d'un rapport financier **consolidé** comportant les éléments suivants :

- Un bilan structuré avec comparaison avec la période précédente
- Un compte d'exploitation structuré avec comparaison avec la période précédente
- Un inventaire structuré des titres (tronqué)
- Un journal des comptes (tronqué)
- Un journal des titres (tronqué)
- Un journal des transactions (tronqué), ordonné par numéro de pièce
- Une représentation graphique de l'évolution des cours de change

Comme le rapport complet comporte plusieurs centaines de pages, il a été considérablement tronqué.

	Solde au 31.12.2011	Solde au 31.12.2012
Actifs		
Liquidité		
Liquidité CHF	19'466'817.16	14'998'237.85
Liquidité monn. étr.	3'028'916.02	2'982'014.81
Floating Rate Notes	1'998'560.00	4'108'320.00
Total Liquidité	24'494'293.18	22'088'572.66
Obligations		
Obligations CHF CH	22'093'223.90	30'119'370.25
Obligations CHF étr.	17'012'403.85	18'755'441.90
Obligations ME	7'290'302.60	6'064'595.11
Total Obligations	46'395'930.35	54'939'407.26
Actions		
Actions Suisse	19'815'325.79	21'674'981.71
Actions étr.	17'758'233.08	19'084'231.55
Total Actions	37'573'558.87	40'759'213.26
Immobilier		
Immobilier Suisse	17'139'295.60	20'086'155.74
Immobilier étr.	4'846'553.39	4'442'520.24
Total Immobilier	21'985'848.99	24'528'675.98
Impôt à la source		
Impôt source EUR	5'249.47	7'619.66
Impôt source SEK	333.05	1'798.67
Impôt source Suisse	-23'575.04	195'299.65
Impôt source année préc.	-8'168.74	5'173.95

	Solde au 31.12.2011	Solde au 31.12.2012
Total Impôt à la source	-26'161.26	209'891.93
Alternative Anlagen		
Plc.alt. Hedge Funds	7'795'078.58	19'288'816.27
Plc.alt. ILS	1'376'818.39	193'666.29
Plc.alt. Private Equity	3'322'708.58	3'825'081.01
Total Alternative Anlagen	12'494'605.55	23'307'563.57
Protec. cap.		
Hypothèques	768'905.63	14'800.00
Convertibles et Options	1'258'587.58	233'786.99
Diverses Protec. cap.	6'511'334.25	727'788.80
Total Protec. cap.	8'538'827.46	976'375.79
Changes à terme		
Opérations sur devise	-552'880.00	282'640.00
Total Changes à terme	-552'880.00	282'640.00
Autres Actifs		
Intérêts courus actif	577'832.98	564'375.81
Total Autres Actifs	577'832.98	564'375.81
Total actifs	151'481'856.12	167'656'716.26

	Solde au 31.12.2011	Solde au 31.12.2012
Passiven		
Compte Post Mandant	3'799'961.00	4'599'961.00
Banque 2 Kapital Mandant	200'000.00	-355.00
Banque 3 Kapital Mandant	2'200'000.00	0.00
Flux de capitaux	116'173.95	1'255'131.53
Compte d'ouverture	144'195'060.61	150'889'216.26
Erfolg Bilanz	708'278.17	8'860'814.83
Durchlaufs Div. IMMO/HYP	-541'056.75	-613'579.19
Hypothèques	-1'101'513.11	-1'229'429.34
Baukonti	1'904'952.25	3'894'956.17
Total Passiven	151'481'856.12	167'656'716.26

	Solde au 31.12.2011	Solde au 31.12.2012
Charge		
Charge Liquidité		
Charge Comptes bancaires	598'925.00	246'525.18
Charge Floating Rate Notes	5'040.00	5'840.00
Total Charge Liquidité	603'965.00	252'365.18
Charge Obligations		
Charge Obligations CHF	331'588.50	278'116.71
Charge Obligations ME	456'268.36	117'918.45
Total Charge Obligations	787'856.86	396'035.16
Charge Actions		
Charge Actions Suisse	2'771'087.07	147'255.69
Charge Actions étr.	3'143'817.00	1'168'875.05
Total Charge Actions	5'914'904.07	1'316'130.74
Charge Immobilier		
Charge Immobilier étr.	325'355.87	93'712.94
Total Charge Immobilier	325'355.87	93'712.94
Charge Alternative Anlagen		
Charge Private Equity	156'136.55	250'469.96
Charge Hedge Funds	157'889.36	664'726.19
Charge Commodities	218'049.06	0.00
Charge ILS	16'973.57	5'309.57
Total Charge Alternative Anlagen	549'048.54	920'505.72
Charge Couvertures		

	Solde au 31.12.2011	Solde au 31.12.2012
Charge Actions Couvertures	2'313'903.44	389'474.24
Total Charge Couvertures	2'313'903.44	389'474.24
Charge Protec. cap.		
Charge Convertibles et Options	172'418.41	40'088.58
Charge Protec. cap. diverses	200'583.79	95'178.33
Total Charge Protec. cap.	373'002.20	135'266.91
Charge Change à termes		
Opérations sur devise Perte change réal.	3'316'840.84	1'049'065.00
Opérations sur devise Perte change n-réa	601'930.00	14'400.00
Total Charge Change à termes	3'918'770.84	1'063'465.00
Autres Charges		
Frais de dépôt	27'427.30	25'825.70
Courtage et frais	20'069.48	52'808.89
Impôt non récupérable	12'552.13	12'004.16
Arrondissement	0.14	-0.03
Total Autres Charges	60'049.05	90'638.72
Erfolg		
Revenu compte d'exploitation	708'278.17	8'860'814.83
Total Erfolg	708'278.17	8'860'814.83
Total charge	15'555'134.04	13'518'409.44

	Solde au 31.12.2011	Solde au 31.12.2012
Produit		
Produit Liquidité		
Produit Bankkonti	512'887.39	290'485.75
Produit FRN	6'327.22	39'031.22
Total Produit Liquidité	519'214.61	329'516.97
Produit Obligations		
Produit Obligations CHF	1'766'264.35	1'937'874.23
Produit Obligations ME	480'881.16	401'849.27
Total Produit Obligations	2'247'145.51	2'339'723.50
Produit Actions		
Produit Actions Suisse	1'022'424.21	3'555'335.02
Produit Actions étr.	2'105'147.84	3'336'105.05
Total Produit Actions	3'127'572.05	6'891'440.07
Produit Immobilier		
Produit Immobilier étr.	403'277.59	968'635.72
Total Produit Immobilier	403'277.59	968'635.72
Produit Alternative Anlagen		
Produit Private Equity	553'962.15	287'994.81
Produit Hedge Funds	574'829.76	338'258.81
Produit Commodities	16'625.82	0.00
Produit ILS	3'608.99	41'833.01
Total Produit Alternative Anlagen	1'149'026.72	668'086.63
Produit Couvertures		
Produit Actions Couvertures	1'974'165.35	152'689.18
Total Produit Couvertures	1'974'165.35	152'689.18
Produit Protec. cap.		
Produit Hypothèques	13'419.00	5'540.40
Compte d'exploitation		
Cantaluppi & Hug SA		

	Solde au 31.12.2011	Solde au 31.12.2012
Produit Convertibles et Options	146'430.59	136'872.32
Produit Protec. cap. Diverse	900'035.40	759'145.77
Total Produit Protec. cap.	1'059'884.99	901'558.49
Produit Changes à terme		
Opérations sur devise Gain change réel.	5'093'155.00	979'870.00
Opérations sur devise Gain change n-réal	49'050.00	297'040.00
Total Produit Changes à terme	5'142'205.00	1'276'910.00
Autres Produits		
Intérêts courus revenu	-71'693.92	-13'457.17
Rétrocessions	4'336.14	3'306.05
Total Autres Produits	-67'357.78	-10'151.12
Total produit	15'555'134.04	13'518'409.44

Nom Numéro de valeur	Date d'échéance	Qté. Banque	Monnaie titre	C. marché C. change	Val.marché Int.courus	Val.march.+int.c. Part en %
CC CHF						
Banque 1 KK CHF		1'501'717	CHF	100.00	1'501'716.66	1'501'716.66
		Banque 1		1.00000		0.90
Banque 1 KK CHF Spez.		1'500'986	CHF	100.00	1'500'986.17	1'500'986.17
		Banque 1		1.00000		0.90
Banque 2 KK CHF		177'448	CHF	100.00	177'448.36	177'448.36
		Banque 2		1.00000		0.11
Banque 2 KK CHF Spez.		4'429'750	CHF	100.00	4'429'749.91	4'429'749.91
		Banque 2		1.00000		2.65
Banque 3 KK CHF		2'944'044	CHF	100.00	2'944'043.61	2'944'043.61
		Banque 3		1.00000		1.76
Banque 4 KK CHF		3'474'863	CHF	100.00	3'474'863.38	3'474'863.38
		Banque 4		1.00000		2.08
Banque 5 KK CHF		969'330	CHF	100.00	969'329.96	969'329.96
		Banque 5		1.00000		0.58
Banque 6 KK CHF		100	CHF	100.00	99.80	99.80
		Banque 6		1.00000		0.00
Total CC CHF					14'998'237.85	14'998'237.85
						8.96
MM EUR						
CALL Banque 5 EUR		128'000	EUR	100.00	155'196.16	155'196.16
CALLBANK5EUR		Banque 5		1.21247		0.09
Total MM EUR					155'196.16	155'196.16
						0.09
MM GBP						
CALL Banque 4 GBP		60'000	GBP	100.00	89'304.00	89'304.00
CALLBANK4GBP		Banque 4		1.48840		0.05
CALL Banque 5 GBP		7'000	GBP	100.00	10'418.80	10'418.80
CALLBANK5GBP		Banque 5		1.48840		0.01

Nom Numéro de valeur	Échéance	Quantité Banque	Monnaie titre	C. marché C. change	V. marché Int. courus	Val.march.+int.c. Part en %
3 7/8 % GENERAL ELECTRIC CAP 2001-2014 1222192	07.05.14	200'000 Banque 4	CHF	104.88 1.00000	209'760.00 5'015.97	214'775.97 0.13
4 % HYPOTHEKENBANK FRANKFURT 1999-2014 839313	01.09.14	40'000 Banque 4	CHF	105.70 1.00000	42'280.00 528.89	42'808.89 0.03
4 % SWISS RE AMERICA 2001-2015 1249133	29.06.15	114'900 Banque 5	CHF	109.10 1.00000	125'355.90 2'310.77	127'666.67 0.08
4 1/2 % VW CREDIT CA 2009-2013 4963325	11.02.13	200'000 Banque 3	CHF	100.52 1.00000	201'040.00 7'975.00	209'015.00 0.12
5/8 % EBN 2012-2019 18584300	04.07.19	400'000 Banque 2	CHF	100.70 1.00000	402'800.00 1'222.22	404'022.22 0.24
Total Obl étr Débiteurs divers					16'103'451.90 161'917.16	16'265'369.06 9.71
Obl étr déb. public						
2 3/4 % STADT KOPENHAGEN 2004-2014 1949941	22.10.14	200'000 Banque 4	CHF	104.70 1.00000	209'400.00 1'038.89	210'438.89 0.13
2 5/8 % PROVINCE OF QUEBEC 2006-2017 2798451	21.06.17	200'000 Banque 1	CHF	110.95 1.00000	221'900.00 2'756.25	224'656.25 0.13
3 3/4 % PROVINCE OF ONTARIO 2008-2018 4359520	30.07.18	180'000 Banque 1	CHF	119.15 1.00000	214'470.00 2'812.50	217'282.50 0.13
3 3/8 % PROVINCE OF ONTARIO 2008-2015 4763081	01.12.15	200'000 Banque 1	CHF	109.55 1.00000	219'100.00 543.75	219'643.75 0.13
3 3/8 % PROVINCE OF ONTARIO 2008-2016 3983667	27.05.16	200'000 Banque 1	CHF	111.45 1.00000	222'900.00 3'993.75	226'893.75 0.14
Total Obl étr déb. public					1'087'770.00 11'145.14	1'098'915.14 0.66
Obl Banques						
1 % BASELandsch. KANTONALBANK 2012-2022 19411207	04.10.22	400'000 Banque 2	CHF	101.40 1.00000	405'600.00 955.56	406'555.56 0.24
1 % RAIFFEISEN 2012-2019 LF1911081.00	08.11.19	100'000 Banque 7	CHF	102.85 1.00000	102'845.05 144.44	102'989.49 0.06
1 % ZÜRCHER KANTONALBANK 2011-2018 14287834	14.12.18	400'000 Banque 5	CHF	103.35 1.00000	413'400.00 177.78	413'577.78 0.25
1 1/2 % RAIFFEISEN 2011-2015 LF1505051.50	05.05.15	100'000 Banque 7	CHF	103.33 1.00000	103'326.28 979.17	104'305.45 0.06

Nom Numéro de valeur	Échéance	Quantité Banque	Monnaie titre	C. marché C. change	V. marché Int. courus	Val.march.+int.c. Part en %
ERRESHEIMER 3138496		800 Banque 1	EUR	40.10 1.21247	38'891.19	38'891.19 0.02
HENKEL 335910		478 Banque 1	EUR	62.20 1.21247	36'050.18	36'050.18 0.02
HENKEL 335910		800 Banque 3	EUR	62.20 1.21247	60'332.51	60'332.51 0.04
INFINEON 1038049		6'000 Banque 1	EUR	6.13 1.21247	44'587.37	44'587.37 0.03
LINDE 340045		340 Banque 4	EUR	132.00 1.21247	54'415.65	54'415.65 0.03
LINDE 340045		320 Banque 2	EUR	132.00 1.21247	51'214.73	51'214.73 0.03
MAN 340813		240 Banque 1	EUR	80.75 1.21247	23'497.67	23'497.67 0.01
MAN 340813		980 Banque 3	EUR	80.75 1.21247	95'948.81	95'948.81 0.06
MERCK 412799		460 Banque 1	EUR	99.83 1.21247	55'678.80	55'678.80 0.03
MUENCHNER RUECKVERSICHERUNG 341960		800 Banque 5	EUR	136.00 1.21247	131'916.74	131'916.74 0.08
SALZGITTER 348595		1'000 Banque 1	EUR	39.43 1.21247	47'801.63	47'801.63 0.03
SAP 345952		700 Banque 4	EUR	60.69 1.21247	51'509.36	51'509.36 0.03
SAP 345952		791 Banque 2	EUR	60.69 1.21247	58'190.86	58'190.86 0.03
THYSSENKRUPP 412006		2'160 Banque 4	EUR	17.76 1.21247	46'512.29	46'512.29 0.03
THYSSENKRUPP 412006		2'200 Banque 1	EUR	17.76 1.21247	47'373.63	47'373.63 0.03
VOLKSWAGEN 352781		680 Banque 1	EUR	172.15 1.21247	141'934.16	141'934.16 0.08
Total Act DE					1'467'563.21	1'467'563.21 0.88

Nom Numéro de valeur	Échéance	Quantité Banque	Monnaie titre	C. marché C. change	V. marché Int. courus	Val.march.+int.c. Part en %
Act DK						
Hedge Funds						
AIG DIVERSIFIED STRATEGIES 1598668		5 Banque 5	USD	0.00 0.91580	0.00	0.00 0.00
HFOF A HFOF_A		600 Banque 6	USD	934.35 0.91580	513'406.64	513'406.64 0.31
HFOF A NOUV SÉRIE HFOF_A_NEUE_SERIE		615 Banque 6	USD	968.23 0.91580	545'323.60	545'323.60 0.33
HFOF B1 HFOF_B1		274 Banque 6	USD	1'652.88 0.91580	415'285.34	415'285.34 0.25
HFOF B2 HFOF_B2		1'060 Banque 6	USD	1'050.98 0.91580	1'019'857.46	1'019'857.46 0.61
HFOF C HFOF_C		625 Banque 6	USD	2'595.40 0.91580	1'485'775.22	1'485'775.22 0.89
HFOF D HFOF_D		299 Banque 6	USD	4'083.53 0.91580	1'117'487.74	1'117'487.74 0.67
HFOF D NOUV SÉRIE HFOF_D_NEUE_SERIE		86 Banque 6	USD	4'128.54 0.91580	326'910.55	326'910.55 0.20
HFOF E HFOF_E		263 Banque 6	USD	2'387.91 0.91580	574'913.01	574'913.01 0.34
HFOF E NOUV SÉRIE HFOF_E_NEUE_SERIE		615 Banque 6	USD	1'017.74 0.91580	573'208.47	573'208.47 0.34
HFOF E NOUV SÉRIE 2 HFOF_E_NEUE_SERIE_2		350 Banque 6	USD	1'000.00 0.91580	320'530.00	320'530.00 0.19
HFOF F HFOF_F		584 Banque 6	USD	1'083.93 0.91580	579'752.93	579'752.93 0.35
HFOF F NOUV SÉRIE HFOF_F_NEUE_SERIE		615 Banque 6	USD	1'016.16 0.91580	572'318.59	572'318.59 0.34
HFOF G HFOF_G		597 Banque 6	USD	1'044.70 0.91580	570'923.01	570'923.01 0.34
HFOF H HFOF_H		600 Banque 6	USD	1'000.81 0.91580	549'925.08	549'925.08 0.33
HFOF H NOUV SÉRIE HFOF_H_NEUE_SERIE		615 Banque 6	USD	1'013.72 0.91580	570'944.34	570'944.34 0.34

Nom Numéro de valeur	Échéance	Quantité Banque	Monnaie titre	C. marché C. change	V. marché Int. courus	Val.march.+int.c. Part en %
HFOF H NOUV SÉRIE 2 HFOF_H_NEUE_SERIE_2		350 Banque 6	USD	1'000.00 0.91580	320'530.00	320'530.00 0.19
REICHMUTH 1519365		0 Banque 5	USD	0.00 0.91580	0.00	0.00 0.00
Total Hedge Funds					19'288'816.25	19'288'816.25 11.52
Insurance Linked Securities						
LGT INSURANCE LINKED 3265439		177 Banque 4	USD	1'193.41 0.91580	193'666.29	193'666.29 0.12
Total Insurance Linked Securities					193'666.29	193'666.29 0.12
Private Equity						
CSA PRIVATE EQUITY 1137822		34 Banque 1	CHF	1'202.39 1.00000	41'097.69	41'097.69 0.02
DENDOR 14270293		1'697 Banque 2	USD	112.65 0.91580	175'037.82	175'037.82 0.10
INVESTINVENT WIND ENERGY 2268793		2'153 Banque 3	EUR	125.25 1.21247	327'032.56	327'032.56 0.20
INVESTINVENT WIND ENERGY ACCUMULATION 2989507		1'488 Banque 3	EUR	131.13 1.21247	236'651.53	236'651.53 0.14
PARTNERS GROUP GLOB. OPPO. 2701643		6'000 Banque 1	EUR	8.35 1.21247	60'744.75	60'744.75 0.04
PEP2 US BALANCED PEP2USDBALANCED		40'909 Banque 7	USD	2.81 0.91580	105'109.00	105'109.00 0.06
PEP2 US VENTURE CAPITAL PEP2USDVENTURE		77'696 Banque 7	USD	1.04 0.91580	74'318.70	74'318.70 0.04
PEP2 WESTERN EUROPE BALANCED PEP2EURBALANCED		28'392 Banque 7	EUR	3.04 1.21247	104'812.51	104'812.51 0.06
PEP2 WESTERN EUROPE VENTURE CAP PEP2EURVENTURE		57'489 Banque 7	EUR	1.09 1.21247	75'841.52	75'841.52 0.05
PEP3 ASIA PEP3ASIA		28'028 Banque 7	USD	3.63 0.91580	93'083.27	93'083.27 0.06
PEP3 US BALANCED PEP3USDBALANCED		226'036 Banque 7	USD	1.44 0.91580	298'111.61	298'111.61 0.18

Date	Transaction	Titre	Monnaie compte			Monnaie de référence		
			Débit	Crédit	Solde	Débit	Crédit	Solde
100020 – Compte Post CC Mandant (CHF)								
30.11.12	SV						1'800'000.00	1'800'000.00
30.11.12	SV						2'400'000.00	4'200'000.00
30.11.12	SV					39.00		4'199'961.00
30.11.12	SV						400'000.00	4'599'961.00
Total Portefeuille 1							1'800'000.00	-1'800'000.00
100027 – Banque 2 CC JPY (JPY)								
30.11.12	SV		6'118.84		6'118.84		68.81	68.81
18.12.12	V	0 % ***TAKASHIMAYA 2009-2014	900'443.24		906'562.08		9'738.29	9'807.10
31.12.12	TRANSF	AUCUN		38.42	906'523.66		0.40	9'806.70
31.12.12	AJVMVCC	Banque 2 KK JPY			906'523.66		236.53	9'570.17
Total			906'562.08	38.42	906'523.66		9'807.10	9'570.17
100028 – Banque 2 CC SEK (SEK)								
30.11.12	SV		8'360.47		8'360.47		1'165.01	1'165.01
31.12.12	TRANSF	AUCUN		2.89	8'357.58		0.40	1'164.61
31.12.12	AJVPVCC	Banque 2 KK SEK			8'357.58		10.10	1'174.71
Total			8'360.47	2.89	8'357.58		1'175.11	1'174.71
100029 – Banque 2 CC CHF (CHF)								
30.11.12	SV						401'977.07	401'977.07
04.12.12	RB	0 % ***SS 10 NAT AUSTRALIA BK 2009-2012					700'000.00	1'101'977.07
04.12.12	CP	0 % ***SS 10 NAT AUSTRALIA BK 2009-2012					623.00	1'102'600.07

Date	Transaction	Titre	Monnaie compte			Monnaie de référence		
			Débit	Crédit	Solde	Débit	Crédit	Solde
04.12.12	TRANSF	Banque 2 KK CHF				1'092.00		1'103'692.07
04.12.12	TRANSF	Banque 2 KK CHF				10'000.00		1'113'692.07
06.12.12	CP	2 1/2 % ***SS 09 WL BANK 2006-2012				5'000.00		1'118'692.07
06.12.12	CP	1 % STADT ZÜRICH 2012-2023				920.83		1'119'612.90
06.12.12	RB	2 1/2 % ***SS 09 WL BANK 2006-2012				200'000.00		1'319'612.90
06.12.12	V	CLARIANT				22'973.22		1'342'586.12
07.12.12	TRANSF	Banque 2 KK CHF Spez.					1'200'000.00	142'586.12
07.12.12	A	SWISSCOM					22'152.53	120'433.59
08.12.12	CP	2 1/8 % GIVAUDAN 2011-2021				745.88		121'179.47
11.12.12	TRANSF	Banque 2 KK CHF				780.00		121'959.47
12.12.12	CP	3 7/8 % ***SS 09 E.ON INTERN 2008-2012				15'500.00		137'459.47
12.12.12	TRANSF	Banque 2 KK CHF Spez.					400'000.00	-262'540.53
12.12.12	RB	3 7/8 % ***SS 09 E.ON INTERN 2008-2012				400'000.00		137'459.47
14.12.12	TRANSF	Banque 2 KK CHF				2'275.00		139'734.47
14.12.12	CP	0 % *x* COMMONWEALTH BK OF AUS 2012-2015				653.18		140'387.65
17.12.12	RB	AST AKTIEN PAZIFIK				190'792.80		331'180.45
18.12.12	TRANSF	Banque 2 KK CHF				61.20		331'241.65
18.12.12	TRANSF	AUCUN					1'787.78	329'453.87
18.12.12	TRANSF	AUCUN					5.40	329'448.47
19.12.12	CP	2 5/8 % ADECCO 2012-2020				1'421.88		330'870.35
20.12.12	CP	3 % BP CAPITAL 2008-2013				2'400.00		333'270.35
20.12.12	CP	3 1/2 % ***SS 10 GDF SUEZ 2008-2012				7'000.00		340'270.35
20.12.12	RB	3 1/2 % ***SS 10 GDF SUEZ 2008-2012				200'000.00		540'270.35
20.12.12	TRANSF	Banque 2 KK CHF Spez.					600'000.00	-59'729.65
20.12.12	CP	3 1/2 % ***SS 10 SYNGENTA 2008-2012				4'550.00		-55'179.65

Date	Transaction	Titre	Monnaie compte			Monnaie de référence		
			Débit	Crédit	Solde	Débit	Crédit	Solde
20.12.12	RB	3 1/2 % ***SS 10 SYNGENTA 2008-2012				200'000.00		144'820.35
21.12.12	V	IST PACIFIC INDEX G				925'453.01		1'070'273.36
22.12.12	TRANSF	Banque 2 KK CHF Spez.					900'000.00	170'273.36
25.12.12	CP	0 % *x* ROCHE 2012-2013				161.68		170'435.04
31.12.12	CP	3 % LANDESB HESSEN-THUERINGEN 2004-2015				6'000.00		176'435.04
31.12.12	CP	1 1/4 % KT GENF 2012-2022				947.92		177'382.96
31.12.12	TRANSF	AUCUN					0.42	177'382.54
31.12.12	CCCI	Banque 2 KK CHF				65.82		177'448.36
Total						3'301'394.49	3'123'946.13	177'448.36

100030 – Banque 2 Capital Mandant (CHF)

30.11.12	SV					355.00		-355.00
Total						355.00		355.00

100032 – Banque 2 CC EUR (EUR)

30.11.12	SV		771'371.41		771'371.41	930'389.63		930'389.63
05.12.12	D	ASML	14'688.00		786'059.41	17'829.32		948'218.95
15.12.12	TRANSF	Banque 2 KK EUR	4'851.72		790'911.13	5'861.36		954'080.31
15.12.12	TRANSF	Banque 2 KK EUR	736.46		791'647.59	889.72		954'970.03
17.12.12	A	ASML		41'121.32	750'526.27		49'698.81	905'271.22
18.12.12	A	SCHNEIDER ELECTRIC		40'731.05	709'795.22		49'200.66	856'070.56
19.12.12	A	BASF		73'351.93	636'443.29		88'605.46	767'465.10
19.12.12	V	RWE	30'343.08		666'786.37	36'652.92		804'118.02
21.12.12	D	UNILEVER	495.72		667'282.09	600.89		804'718.91
21.12.12	TRANSF	AUCUN		1'636.98	665'645.11		1'975.98	802'742.93
22.12.12	TRANSF	AUCUN		13'679.70	651'965.41		16'530.69	786'212.24
29.12.12	RB	0 % ***UBS DEUTSCHE POST 2010-2012	60'000.00		711'965.41	72'453.60		858'665.84
31.12.12	CCCI	Banque 2 KK EUR	96.53		712'061.94	116.53		858'782.37
31.12.12	AJVPCC	Banque 2 KK EUR			712'061.94	4'571.37		863'353.74

Date	Transaction	Titre	Monnaie compte			Monnaie de référence		
			Débit	Crédit	Solde	Débit	Crédit	Solde
Total			882'582.92	170'520.98	712'061.94	1'069'365.34	206'011.60	863'353.74

Données de base de la transaction				Monnaie titre		C. change	Monnaie de référence			
No. pièce	Date	Transaction	Qté.	C. compta.	Valeur compta.		Valeur compta.	G/P réal.	G/P n-réal.	Revenu
Inv global										
10937506 - 0 % ***CA CIB FIN EMMA PANIER MONNAIES						USD				
		Solde reporté	400'000	98.30	393'200.00	0.92570	363'985.24			
353362	01.12.12	AJVMVCOST (S)	400'000	98.30	-3'760.00	0.92570	1'348.42		1'348.42	
353463	31.12.12	AJVMVCOST	400'000	98.34	3'920.00	0.91580	-5'094.57		-5'094.57	
		Solde	400'000	98.34	393'360.00	0.91580	360'239.09		-3'746.15	
2951755 - 0 % ***ING ASIA PACIFIC BASKET						AUD				
		Solde reporté	400'000	95.04	380'160.00	0.96290	366'056.06			
353363	01.12.12	AJVPVCOST (S)	400'000	95.04	-14'320.00	0.96290	-16'253.39		-16'253.39	
353464	31.12.12	AJVPVCOST	400'000	96.49	20'120.00	0.95230	17'747.04		17'747.04	
		Solde	400'000	96.49	385'960.00	0.95230	367'549.71		1'493.65	
10713424 - 0 % ***SS 10 COMMONWEALTH BK 2009-2012						CHF				
		Solde reporté	400'000	100.01	400'040.00	1.00000	400'040.00			
5906	01.12.12	AJVPVCOST (S)	400'000	100.01	-200.00	1.00000	-200.00		-200.00	
2592	10.12.12	CP	400'000			1.00000				359.96
2593	10.12.12	RB	-400'000	100.00	-399'840.00	1.00000	-399'840.00	160.00		
		Solde				1.00000	160.00	-200.00		359.96
10500408 - 0 % ***SS 10 NAT AUSTRALIA BK 2009-2012						CHF				
		Solde reporté	700'000	100.00	700'000.00	1.00000	700'000.00			
30818	01.12.12	AJVPVCOST (S)	700'000	100.00	-830.00	1.00000	-830.00		-830.00	
2558	04.12.12	CP	700'000			1.00000				623.00
2557	04.12.12	RB	-700'000	100.00	-699'170.00	1.00000	-699'170.00	830.00		
		Solde				1.00000	830.00	-830.00		623.00
10701351 - 0 % ***TAKASHIMAYA 2009-2014						JPY				
		Solde reporté	460'000	99.34	456'941.00	1.12450	5'138.30			
		Solde reporté	900'000	99.34	894'015.00	1.12450	10'053.20			

Données de base de la transaction				Monnaie titre		C. change	Monnaie de référence			
No. pièce	Date	Transaction	Qté.	Cours compta.	Valeur compta.		Valeur compta.	G/P réal.	G/P n-réal.	Revenu
3904063	01.12.12	AJVMVCOST (S)	460'000	99.34	9'724.40	1.12450	559.64		559.64	
30825	01.12.12	AJVMVCOST (S)	900'000	99.34	19'026.00	1.12450	1'094.94		1'094.94	
2696	18.12.12	V	-900'000	100.30	-913'041.00	1.08150	-11'148.14	-1'385.44		
3904377	31.12.12	AJVMVCOST	460'000	101.78	1'504.20	1.05570	-755.47		-755.47	
		Solde	460'000	101.78	468'169.60	1.05570	4'942.47	-1'385.44		899.11
10629607 - 0 % ***UBS DEUTSCHE POST 2010-2012					EUR					
		Solde reporté	60'000	100.20	60'120.00	1.20615	72'513.74			
30824	01.12.12	AJVPVCOST (S)	60'000	100.20	-1'260.00	1.20615	-893.48		-893.48	
2857	29.12.12	RB	-60'000	100.00	-58'860.00	1.20756	-71'620.26	833.34		
		Solde						833.34		-893.48
1890194 - 0 % *HSH NORDBANK VOLATILITY 2004-2014					USD					
		Solde reporté	200'000	95.61	191'220.00	0.92570	177'012.35			
15291	01.12.12	AJVMVCOST (S)	200'000	95.61	3'740.00	0.92570	5'879.63		5'879.63	
15585	31.12.12	AJVMVCOST	200'000	96.15	-2'660.00	0.91580	-6'783.64		-6'783.64	
		Solde	200'000	96.15	192'300.00	0.91580	176'108.34			-904.01
1699654 - 0 % *KA FINANCE INFL EUR 2003-2013					CHF					
		Solde reporté	300'000	96.29	288'870.00	1.00000	288'870.00			
353325	01.12.12	AJVPVCOST (S)	300'000	96.29	-291.00	1.00000	-291.00		-291.00	
353421	31.12.12	AJVPVCOST	300'000	97.13	2'811.00	1.00000	2'811.00		2'811.00	
		Solde	300'000	97.13	291'390.00	1.00000	291'390.00			2'520.00
1601059 - 0 % *RABOBANK EUR INFLA 2003-2013					CHF					
		Solde reporté	220'000	100.56	221'232.00	1.00000	221'232.00			
15280	01.12.12	AJVPVCOST (S)	220'000	100.56	-44.00	1.00000	-44.00		-44.00	
15574	31.12.12	AJVPVCOST	220'000	100.64	220.00	1.00000	220.00		220.00	
		Solde	220'000	100.64	221'408.00	1.00000	221'408.00			176.00
1832995 - 0 % *RBOS STEEPNESS 2004-2014					CHF					
		Solde reporté	200'000	103.66	207'320.00	1.00000	207'320.00			
15286	01.12.12	AJVPVCOST (S)	200'000	103.66	-9'080.00	1.00000	-9'080.00		-9'080.00	
15580	31.12.12	AJVPVCOST	200'000	104.41	10'580.00	1.00000	10'580.00		10'580.00	
		Solde	200'000	104.41	208'820.00	1.00000	208'820.00			1'500.00

Données de base de la transaction				Monnaie titre		C. change	Monnaie de référence			
No. pièce	Date	Transaction	Qté.	Cours compta.	Valeur compta.		Valeur compta.	G/P réal.	G/P n-réal.	Revenu
1811603 - 0 % *UBS CLN GE 2004-2014				CHF						
		Solde reporté	100'000	102.17	102'170.00	1.00000	102'170.00			
15282	01.12.12	AJVPVCOST (S)	100'000	102.17	-1'970.00	1.00000	-1'970.00			-1'970.00
15576	31.12.12	AJVPVCOST	100'000	101.87	1'670.00	1.00000	1'670.00			1'670.00
		Solde	100'000	101.87	101'870.00	1.00000	101'870.00			-300.00
1811605 - 0 % *UBS CLN GE 2004-2014				CHF						
		Solde reporté	100'000	102.17	102'170.00	1.00000	102'170.00			
15283	01.12.12	AJVPVCOST (S)	100'000	102.17	-1'980.00	1.00000	-1'980.00			-1'980.00
15577	31.12.12	AJVPVCOST	100'000	101.86	1'670.00	1.00000	1'670.00			1'670.00
		Solde	100'000	101.86	101'860.00	1.00000	101'860.00			-310.00
1811606 - 0 % *UBS CLN GE 2004-2014				CHF						
		Solde reporté	100'000	101.59	101'590.00	1.00000	101'590.00			
15284	01.12.12	AJVPVCOST (S)	100'000	101.59	-2'960.00	1.00000	-2'960.00			-2'960.00
15578	31.12.12	AJVPVCOST	100'000	101.38	2'750.00	1.00000	2'750.00			2'750.00
		Solde	100'000	101.38	101'380.00	1.00000	101'380.00			-210.00
1811607 - 0 % *UBS CLN GE 2004-2014				CHF						
		Solde reporté	100'000	101.63	101'630.00	1.00000	101'630.00			
15285	01.12.12	AJVPVCOST (S)	100'000	101.63	-2'920.00	1.00000	-2'920.00			-2'920.00
15579	31.12.12	AJVPVCOST	100'000	101.42	2'710.00	1.00000	2'710.00			2'710.00
		Solde	100'000	101.42	101'420.00	1.00000	101'420.00			-210.00
3564108 - 0 % *UBS JERSEY BASKET CURR 2007-2015				EUR						
		Solde reporté	244'000	97.91	238'900.40	1.20615	288'149.72			
30809	01.12.12	AJVPVCOST (S)	244'000	97.91	-20'178.80	1.20615	-22'011.46			-22'011.46
31060	31.12.12	AJVPVCOST	244'000	98.14	20'740.00	1.21247	24'201.75			24'201.75
		Solde	244'000	98.14	239'461.60	1.21247	290'340.01			2'190.29
2066842 - 0 % *UBS STIRN (EX EQUILIBOR) 2005-2015				EUR						
		Solde reporté	300'000	107.22	321'660.00	1.20615	387'970.21			
30806	01.12.12	AJVMVCOST (S)	300'000	107.22		1.20615	3'422.46			3'422.46
31057	31.12.12	AJVMVCOST	300'000	107.22		1.21247	-1'389.57			-1'389.57
		Solde	300'000	107.22	321'660.00	1.21247	390'003.10			2'032.89

No. pièce	Date compta.	Transaction	Qté. / Nominal	Titre		
Compte	Nom du compte	Monnaie de compte		Cours devise	Monnaie de référence	
		Débit	Crédit		Débit	Crédit
2534	05.12.12	CP	200'000	3 3/8 % ASSIST PUB HOPIT PARIS 2008-2014		
100050	Banque 1 CC CHF				6'750.00	
420005	Obl. CH Dividendes					6'750.00
2535	04.12.12	V	100	CS REAL ESTATE INTERNATIONAL		
100050	Banque 1 CC CHF				94'833.75	
160056	Immo étr. coll. fonds					100'500.00
320025	Courtage et frais				166.25	
420053.02	Immob.coll. Perte en cap. réal.				5'500.00	
2537	03.12.12	CP	200'000	3 3/8 % PROVINCE OF ONTARIO 2008-2015		
100050	Banque 1 CC CHF				6'750.00	
420005	Obl. CH Dividendes					6'750.00
2538	03.12.12	DVT	2'000'000	Banque 1 KK USD		
100050	Banque 1 CC CHF				1'908'000.00	
100052	Banque 1 CC USD		2'000'000.00 USD	0.92570		1'851'400.00
110000.01	Compte d'aide ePOCA					56'600.00
2539	03.12.12	DVTC	1	CAT Banque 1 CHF/USD 06.12.2012		
110000.01	Compte d'aide ePOCA				56'600.00	
162200.01	Opération sur devise Gain change réal.					56'600.00
2540	04.12.12	DA	2'000'000	Banque 1 KK USD		
100050	Banque 1 CC CHF					1'851'400.00
100052	Banque 1 CC USD		2'000'000.00 USD	0.92570	1'851'400.00	
2541	03.12.12	DVT	2'000'000	Banque 1 KK EUR		

No. pièce	Date compta.	Transaction	Qté. / Nominal	Titre		
Compte	Nom du compte	Kontowährung		Cours devise	Monnaie de référence	
		Débit	Crédit		Débit	Crédit
100050	Banque 1 CC CHF				2'400'000.00	
100051	Banque 1 CC EUR		2'000'000.00 EUR	1.21370		2'427'400.00
110000.01	Compte d'aide ePOCA				27'400.00	
2542	03.12.12	DVTC	1	CAT Banque 1 CHF/EUR 06.12.2012		
110000.01	Compte d'aide ePOCA					27'400.00
162200.02	Opération sur devise Perte change réal.				27'400.00	
2543	03.12.12	DAT	2'000'000	Banque 1 KK EUR		
100050	Banque 1 CC CHF					2'427'400.00
100051	Banque 1 CC EUR		2'000'000.00 EUR	1.21370	2'427'400.00	
2545	03.12.12	V	100	CS REAL ESTATE INTERNATIONAL		
100050	Banque 1 CC CHF				94'334.63	
160056	Immo étr. coll. fonds					100'500.00
320025	Courtage et frais				165.38	
320025.01	Arrondissement					0.01
420053.02	Immob.coll. Perte en cap. réal.				6'000.00	
2572	05.12.12	TRANSF	116'000	Banque 1 KK CHF Spez.		
100050	Banque 1 CC CHF					116'000.00
100055	Banque 1 CC CHF Spec.				116'000.00	
	Banque 1 CC CHF					
2581	06.12.12	V	95	CS REAL ESTATE INTERNATIONAL		
100050	Banque 1 CC CHF				90'851.93	
160056	Immo étr. coll. fonds					95'676.00
320025	Courtage et frais				159.27	
420053.02	Immob.coll. Perte en cap. réal.				4'664.80	
2600	11.12.12	TRANSF	44'000	Banque 1 KK CHF Spez.		

No. pièce	Date compta.	Transaction	Qté. / Nominal	Titre		
Compte	Nom du compte	Kontowährung		Cours devise	Monnaie de référence	
		Débit	Crédit		Débit	Crédit
100050	Banque 1 CC CHF					44'000.00
100055	Banque 1 CC CHF Spec.				44'000.00	
Banque 1 CC CHF						
2601	12.12.12	CP	400'000	3 1/4 % PFANDBRIEFZENTRALE 2007-2018		
100050	Banque 1 CC CHF				8'450.00	
110020	Impôt anticipé Suisse				4'550.00	
420005	Obl. CH Dividendes					13'000.00
2616	14.12.12	D	718	1A IMMO PK		
100050	Banque 1 CC CHF				37'321.44	
420011	Immobilier coll.					37'321.44
2617	13.12.12	D	400	GLENCORE		
100052	Banque 1 CC USD		40.00 USD	0.95900	38.36	
420009	Actions étrangères					38.36
2618	14.12.12	D	1'000	SABMILLER		
100054	Banque 1 CC GBP		150.58 GBP	1.48844	224.13	
420009	Actions étrangères					224.13
2623	14.12.12	TRANSF	24'000	Banque 1 KK CHF Spez.		
100050	Banque 1 CC CHF					24'000.00
100055	Banque 1 CC CHF Spec.				24'000.00	
Banque 1 CC CHF						
2624	17.12.12	D	1'200	COCA-COLA		
100052	Banque 1 CC USD		306.00 USD	0.91781	280.85	
420009	Actions étrangères					280.85
2625	17.12.12	CP	200'000	2 5/8 % STATNETT 2006-2017		
100050	Banque 1 CC CHF				5'250.00	

EUR



USD



GBP



JPY

