

Allianz PIMCO Mortgage

ISIN (A): AT0000675459

ISIN (T): AT0000675467

Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH

Halbjahresbericht*

vom 15. 09. 2011 – 14. 03. 2012

www.allianzinvest.at



* Seit 1.9.2011 ist das Investmentfondsgesetz (InvFG) 2011 in Kraft. Die im Rechenschaftsbericht genannten Bestimmungen bzw. gesetzlichen Verweise beziehen sich noch auf das InvFG 1993. Dies gilt auch für die Fondsbestimmungen, welche auf Basis der im Zulassungszeitpunkt geltenden Rechtslage genehmigt wurden.

Allgemeines zur **Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH**

Die Gesellschaft	Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH Hietzinger Kai 101-105, 1130 Wien Tel: 01/ 505 54 80; Fax: 01/ 505 54 81
Gründung	29. April 1991
Gesellschafter	Allianz Investmentbank AG
Aufsichtsrat	Dr. Harald Lankisch (Vorsitzender) Univ.-Prof. Dr. Christian Nowotny (Vorsitzender-Stellvertreter) Univ.-Prof. Dipl. Ing. Dr. Engelbert Dockner RA Dr. Corvin Hummer Dkfm. Reinhard Pinzer
Geschäftsführung	Mag. Sonja König Mag. Martin Maier Mag. Christian Ramberger
Prokurist	Franz Groder
Staatskommissär Staatskommissär-Stellvertreter	Ministerialrat Mag. Gerhard Wallner AD Thomas Galee
Prüfer	KPMG Austria GmbH Wirtschaftsprüfungs- und Steuerberatungsgesellschaft
Depotbank	Allianz Investmentbank AG

Zusammensetzung des Fondsvermögens per 14. März 2012

1. Wertpapiere	EUR	%
Amtlich notierte Wertpapiere:		
Anleihen:		
USD	121.509.015,53	75,11
Strukturierte Produkte:		
USD	20.383.999,93	12,60
nicht notierte Wertpapiere:		
Anleihen:		
USD	2.868.438,77	1,77
Strukturierte Produkte:		
USD	51.342,49	0,03
Neuemissionen:		
Anleihen:		
USD	11.402.475,84	7,05
Strips:		
USD	2.677.585,13	1,66
Strukturierte Produkte:		
USD	1.607.775,32	0,99
Summe Wertpapiere	160.500.633,01	99,21
2. Derivative Produkte		
Devisentermingeschäfte:		
EUR	-1.710.632,49	-1,06
Forwards:		
USD	93.834,96	0,06
Summe Derivative Produkte	-1.616.797,53	-1,00
3. Bankguthaben/ -verbindlichkeiten		
Fremdwährungsguthaben	507.518,60	0,31
EUR	509.504,23	0,31
hereingenommene Sicherstellung für Derivative Produkte (Collaterals):		
EUR	1.294.324,88	0,80
Summe Bankguthaben/ -verbindlichkeiten	2.311.347,71	1,42
4. Abgrenzungen		
Anteilige Zinsen (aus Wertpapieren und Bankguthaben) und Aufwendungen	583.113,15	0,37
Fondsvermögen	161.778.296,34	100,00

Darstellung der Fondsdaten zum Berichtsstichtag:

Fondsdaten in EUR	per 14.09.2011	per 14.03.2012
Fondsvolumen gesamt	161.556.824,87	161.778.296,34
Errechneter Wert je Ausschüttungsanteil	63,41	62,74
Ausgabepreis je Ausschüttungsanteil	65,65	64,95
Errechneter Wert je Thesaurierungsanteil	79,44	80,15
Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil	82,25	83,00
Ausschüttung/Auszahlung in EUR		per 15.11.2011
Ausschüttung je Ausschüttungsanteil		1,62
Auszahlung je Thesaurierungsanteil		0,51

Umlaufende Anteile zum Berichtsstichtag:

Ausschüttungsanteile	2.309.973
Thesaurierungsanteile	210.153
Gesamt umlaufende Anteile per 14.03.2012	2.520.126

Überblick über die ausgewiesenen Erträge und Fondsentwicklung der letzten Rechnungsjahre in EUR:

Datum	Fonds- vermögen gesamt	Errechneter Wert je Ausschüttungs- anteil	Ausschüttung je Anteil	Anteile	Wertent- wicklung in %
14.09.08	186.398.836,52	54,93	2,58	2.945.033	9,41
14.09.09	200.336.234,61	56,38	2,01	3.053.543	7,78
14.09.10	207.452.033,85	60,26	1,68	3.056.286	10,74
14.09.11	161.556.824,87	63,41	1,62	2.327.350	8,23
14.03.12	161.778.296,34	62,74	-	2.309.973	-

Datum	Errechneter Wert je Thesaurierungs- anteil	Zur Thesaurierung verwendeter Betrag	Auszahlung je Anteil	Anteile	Wertent- wicklung in %
14.09.08	63,22	3,47	0,74	389.774	9,42
14.09.09	67,33	2,96	0,60	418.617	7,78
14.09.10	73,91	0,14	0,51	315.070	10,74
14.09.11	79,44	13,60	0,51	176.106	8,22
14.03.12	80,15	-	-	210.153	-

Anteilswertermittlung und Wertpapierbewertung

Der Wert eines Anteiles ergibt sich aus der Teilung des Gesamtwertes des Kapitalanlagefonds einschließlich der Erträge durch die Zahl der Anteile. Der Gesamtwert des Kapitalanlagefonds ist aufgrund der jeweiligen Kurswerte der zu ihm gehörigen Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Bezugsrechte zuzüglich des Wertes der zum Fonds gehörenden Finanzanlagen, Geldbeträge, Guthaben, Forderungen und sonstigen Rechte abzüglich Verbindlichkeiten, von der Depotbank zu ermitteln.

Das Nettovermögen wird nach folgenden Grundsätzen ermittelt:

- a) Der Wert von Vermögenswerten, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, wird grundsätzlich auf der Grundlage des letzten verfügbaren Kurses ermittelt.
- b) Sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für einen Vermögenswert, welcher an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird, der Kurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, wird auf die Kurse zuverlässiger Datenprovider oder alternativ auf Marktpreise gleichartiger Wertpapiere oder andere anerkannte Bewertungsmethoden zurückgegriffen.

Es besteht das Risiko, dass aufgrund von Kursbildungen auf illiquiden Märkten die Bewertungskurse bestimmter Wertpapiere von ihren tatsächlichen Veräußerungen abweichen können (Bewertungsrisiko).

Berechnung des Gesamtrisikos

Die Berechnung des Gesamtrisikos erfolgt nach dem Commitment Approach.

Vermögensaufstellung für den Allianz PIMCO Mortgage per 14. März 2012

ISIN	Bezeichnung	Zugang	Abgang	Stand am 14.03.2012	Tageskurs	Kurswert EUR	Anteil in %
Amtlich notierte Wertpapiere							
Anleihen							
Währung: USD							
US31395M2F53	1,394 FHLMC STRUCTURED PASS THROUGH 25.02.45	0,00	-68.714,58	1.199.248,32	95,438890	876.579,06	0,54
US31397NNR25	5,463 FANNIE MAE REMICS 25.03.39	0,02	-271.671,82	2.560.896,55	104,916390	2.057.746,96	1,27
US36200EHY05	6,000 GINNIE MAE I POOL 15.11.32	0,00	-42,02	3.647,34	112,546604	3.143,87	0,00
US36200QW673	6,000 GINNIE MAE I POOL 15.01.32	0,00	-287,53	1.904,05	112,546426	1.641,21	0,00
US36200RLF72	6,000 GINNIE MAE I POOL 15.12.31	0,00	-1.112,76	8.855,77	112,546868	7.633,36	0,00
US36200X4D81	6,000 GINNIE MAE I POOL 15.03.32	0,01	-608,65	2.804,65	112,546664	2.417,50	0,00
US36202E4G19	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.04.39	0,00	-53.231,46	588.576,35	109,015623	491.414,70	0,30
US36202E5G00	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.05.39	135.391,02	-9.896,77	125.494,25	110,296870	106.009,21	0,07
US36202EKM02	6,500 GINNIE MAE II POOL 20.09.36	0,00	-18.280,38	112.951,24	112,828124	97.603,40	0,06
US36202EWE57	6,000 GINNIE MAE II POOL 20.09.38	3.959.124,63	-2.002.264,84	1.956.859,79	111,984375	1.678.315,99	1,04
US36202EZE21	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.01.39	0,00	-65.578,80	695.071,63	109,015625	580.329,84	0,36
US36202FAV85	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.08.39	679.435,68	-51.738,63	627.697,05	110,296875	530.236,83	0,33
US36202FB478	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.10.39	347.264,44	-25.709,98	321.554,46	110,296875	271.627,87	0,17
US36202FBJ49	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.09.39	89.140,90	-6.672,45	82.468,45	110,296868	69.663,87	0,04
US36202FDW32	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.01.40	672.402,12	-18.081,85	654.320,27	109,015625	546.305,68	0,34
US36202FDX15	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.01.40	770.146,12	-49.588,13	720.557,99	110,296874	608.679,58	0,38
US36202FGE07	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.05.40	157.183,45	-12.008,27	145.175,18	110,296870	122.634,35	0,08
US36202FGW05	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.06.40	45.590.103,15	-22.052.524,36	23.537.578,79	109,015625	19.652.017,01	12,15
US36202FHX78	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.07.40	19.860.953,25	-20.169.385,34	10.496.662,04	109,015625	8.763.882,75	5,42
US36202FJR82	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.08.40	288.611,37	-21.851,28	266.760,09	110,296874	225.341,22	0,14
US36202FKP08	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.09.40	2.833.487,07	-226.737,58	2.606.749,49	110,296874	2.202.009,03	1,36
US36202FLQ71	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.10.40	241.565,25	-20.763,57	220.801,68	110,296874	186.518,61	0,12
US36202FM780	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.12.40	7.164.477,17	-6.951.318,40	213.158,77	107,859371	176.083,10	0,11
US36202FM947	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.12.40	1.434.479,61	-117.911,47	1.316.568,14	110,296875	1.112.149,42	0,69
US36202FMC76	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.11.40	1.135.640,59	-103.763,30	1.031.877,29	110,296874	871.661,47	0,54
US36202FP833	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.02.41	1.593.055,03	-181.346,67	1.411.708,36	110,296874	1.192.517,56	0,74
US36202FPH37	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.01.41	1.659.080,86	-146.758,18	1.512.322,68	110,296873	1.277.509,86	0,79
US36202FQ666	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.03.41	999.999,91	-861.248,87	138.751,04	107,859372	114.617,44	0,07
US36202FQ740	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.03.41	10.287.182,99	-1.170.827,44	9.116.355,55	109,015624	7.611.435,95	4,70
US36202FV864	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.08.41	4.526.033,79	-132.987,61	4.393.046,18	107,859374	3.628.943,94	2,24
US36202FV948	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.08.41	8.386.800,37	-276.684,37	8.110.116,00	109,015624	6.771.305,50	4,19
US36202TEQ58	6,000 GINNIE MAE I POOL 15.07.34	0,00	-1.287,45	131.393,48	112,546871	113.256,68	0,07
US36203SW780	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.09.23	0,00	-172,25	4.586,48	114,452949	4.020,34	0,00
US36206GR853	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.38	0,00	-5.344,97	532.306,62	114,453124	466.601,48	0,29
US36206QVP08	7,500 GINNIE MAE I POOL 15.06.26	0,00	-311,48	393,6311	103,444570	311,85	0,00
US36207KEG13	7,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.28	0,00	-8,13	547,9939	110,159985	462,33	0,00
US36207MQM19	7,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.28	0,00	-11,05	693,1038	102,921092	546,33	0,00
US36208AZN44	1,038 GINNIE MAE II POOL 20.03.58	0,00	-377.295,73	16.670.559,91	100,260000	12.800.722,49	7,91
US36208AZY09	1,221 GINNIE MAE II POOL 20.08.58	10.329,36	-265.152,12	10.861.007,40	100,960000	8.398.003,39	5,19

US36208PYQ52	6,000 GINNIE MAE I POOL 15.01.29	0,00	-3.212,72	39.564,47	112,546853	34.103,21	0,02
US36209FPY96	7,500 GINNIE MAE I POOL 15.05.29	0,00	-4,89	367,4297	110,219724	310,16	0,00
US3620A23C86	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.09.41	77.946,45	-586,18	77.360,27	107,796870	63.867,61	0,04
US3620A5A580	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.40	1.999.999,96	0,00	1.999.999,96	108,921875	1.668.405,79	1,03
US3620A5A903	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.40	2.000.000,04	0,00	2.000.000,04	108,921875	1.668.405,86	1,03
US3620AAQZ43	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.09.41	399.960,11	-6.510,92	393.449,19	107,796874	324.826,47	0,20
US3620AQKK89	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.03.40	34.538,63	-249,85	34.288,78	107,796865	28.308,36	0,02
US3620AQY318	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.02.40	52.898,65	-1.214,85	51.683,80	107,796873	42.669,46	0,03
US3620ASXT18	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.09.41	227.292,17	-1.361,05	225.931,12	107,796872	186.525,75	0,12
US3620C4YB08	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.10.40	844.156,57	-29.993,67	814.162,90	107,796875	672.162,18	0,42
US36211BBF04	7,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.29	0,01	-14,68	676,566	102,551710	531,38	0,00
US36211SDX27	6,000 GINNIE MAE I POOL 15.05.35	0,00	-62,57	5.521,96	112,546774	4.759,73	0,00
US36212C3P46	7,500 GINNIE MAE I POOL 15.09.30	0,00	-13,51	796,9884	109,848525	670,5	0,00
US36212EJD04	7,500 GINNIE MAE I POOL 15.09.30	0,00	-11,53	954,1295	107,120679	782,77	0,00
US36212USJ15	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.03.36	0,00	-685,87	83.579,31	114,453124	73.262,71	0,05
US36212UTA96	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.08.36	0,00	-4.816,45	40.535,65	114,453121	35.532,14	0,02
US3621672Z04	7,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.17	0,00	-101,87	1.240,69	101,362145	963,15	0,00
US36217YMT28	7,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.17	0,00	-87,53	157,8169	100,736993	121,75	0,00
US36225BUE63	7,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.32	0,00	-50.375,26	440.140,89	117,407070	395.769,71	0,24
US36225BY850	6,000 GINNIE MAE I POOL 15.03.33	0,00	-10.864,59	114.064,61	112,546871	98.319,79	0,06
US36225CM945	2,000 GINNIE MAE II POOL 20.03.30	0,00	-21.520,13	997.884,37	103,186932	788.608,60	0,49
US36230M3Y12	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.11.40	234.253,61	-2.586,23	231.667,38	107,796872	191.261,53	0,12
US36230UD979	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.41	39.234,59	-9.519.471,52	5.495.732,05	104,828124	4.412.248,47	2,73
US36241LG267	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.40	15.709.929,77	-7.977.841,41	7.732.088,36	108,921875	6.450.130,66	3,99
US36241LL382	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.08.40	529.897,82	-9.794,40	520.103,42	107,796874	429.390,54	0,27
US36241LL796	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.07.40	899.998,82	-69.692,31	830.306,51	110,296873	701.387,85	0,43
US36241LSM99	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.12.40	735.514,70	-64.406,91	671.107,79	110,296875	566.907,34	0,35
US36241LYK69	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.09.41	545.102,66	-8.610,14	536.492,52	107,796875	442.921,16	0,27
US36290TWR66	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.36	0,01	-1.091,65	11.078,42	114,453117	9.710,95	0,01
US36290UHU34	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.37	0,00	-9.105,58	84.755,16	114,453124	74.293,42	0,05
US36290VJ218	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.36	0,01	-4.901,75	31.642,46	114,453094	27.736,66	0,02
US36291NGC92	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.03.37	0,01	-19.429,93	47.034,70	114,453104	41.228,97	0,03
US36291SAZ39	6,000 GINNIE MAE I POOL 15.12.34	0,00	-8.311,18	854.031,56	112,546874	736.145,99	0,46
US36292L4Q47	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.36	0,00	-6.546,51	47.643,58	114,453112	41.762,70	0,03
US36292LGP31	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.36	0,01	-42.178,28	11.559,63	114,453056	10.132,76	0,01
US36292MGT36	6,000 GINNIE MAE I POOL 15.05.36	0,00	-4.874,75	24.198,35	112,546860	20.858,14	0,01
US36292MYP12	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.05.36	0,01	-2.836,82	12.767,87	114,453074	11.191,86	0,01
US36294NZY74	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.06.36	0,00	-127,85	14.477,41	114,453119	12.690,39	0,01
US36294RQ932	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.02.37	0,00	-502,02	65.874,49	114,453119	57.743,28	0,04
US36294SA231	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.36	0,00	-6.080,55	46.108,55	114,453118	40.417,14	0,02
US36294SG436	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.36	0,01	-4.829,29	24.694,58	114,453123	21.646,41	0,01
US36294STR84	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.08.36	0,01	-4.738,76	19.736,29	114,453110	17.300,14	0,01
US36294T2N41	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.36	0,00	-69,40	7.042,42	114,453073	6.173,14	0,00
US36294TFF75	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.36	0,00	-62,06	8.139,93	114,453052	7.135,17	0,00
US36294TZW88	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.09.36	0,01	-11.178,91	206.648,07	114,453118	181.140,50	0,11
US36294WQS07	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.36	0,00	-2.000,14	15.205,12	114,453124	13.328,27	0,01

US36294XCV64	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.09.37	0,00	-24.410,57	139.986,31	114,453121	122.707,13	0,08
US36294YNL47	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.37	0,02	-1.046,62	132.270,78	114,453120	115.943,96	0,07
US36294YNW02	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.37	0,00	-165,55	21.390,45	114,453107	18.750,11	0,01
US36294YP245	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.02.37	0,00	-58,03	3.428,16	114,452916	3.005,00	0,00
US36295CXT34	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.02.37	0,00	-13.746,29	13.992,11	114,453125	12.264,99	0,01
US36295F6K53	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.09.37	0,00	-261,29	36.853,03	114,453119	32.304,08	0,02
US36295FGG37	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.37	0,00	-187,03	25.762,25	114,453117	22.582,29	0,01
US36295HM319	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.37	0,00	-5.445,61	17.876,22	114,453070	15.669,66	0,01
US36295HWP18	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.03.38	0,00	-8.450,83	127.784,07	114,453120	112.011,07	0,07
US36295LUA78	6,000 GINNIE MAE I POOL 15.09.37	0,00	-4.152,87	548.101,87	112,546874	472.445,06	0,29
US36295NKF32	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.05.38	0,00	-1.325.003,01	1.820.404,33	114,453123	1.595.703,16	0,99
US36295NNM55	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.06.38	0,00	-23.128,88	406.041,33	114,453124	355.921,71	0,22
US36295TSH85	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.38	0,00	-778,90	97.448,94	114,453121	85.420,34	0,05
US36296DND65	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.38	0,00	-27.986,65	649.800,22	114,453124	569.592,28	0,35
US36296GPK12	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.05.38	0,00	-64,85	8.909,18	114,453090	7.809,47	0,00
US36296GSC68	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.06.38	0,00	-599,65	8.953,73	114,453113	7.848,52	0,00
US36296KP637	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.38	0,00	-3.743,48	23.153,47	114,453098	20.295,51	0,01
US36296LST88	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.38	0,01	-272,48	43.075,38	114,453124	37.758,38	0,02
US36296LWW61	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.38	0,00	-2.216,61	12.746,97	114,453104	11.173,54	0,01
US36296NM521	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.08.38	0,00	-764,13	94.071,43	114,453125	82.459,74	0,05
US36296Q2T53	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.39	0,00	-47.252,38	754.772,08	108,921875	629.633,07	0,39
US36296RUT21	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.09.38	0,00	-2.063,27	29.922,70	114,453108	26.229,19	0,02
US36296RVM68	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.09.38	0,00	-22.667,80	90.906,49	114,453122	79.685,46	0,05
US36296XT798	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.04.39	77.897,28	-3.578,22	74.319,06	107,796869	61.356,83	0,04
US36296XYV09	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.39	0,00	-7.637,71	87.985,23	108,921869	73.397,53	0,05
US36296Y6D93	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.38	0,00	-3.439,97	13.219,29	114,453117	11.587,56	0,01
US36297FRG99	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.39	0,00	-101.310,29	1.759.006,38	108,921875	1.467.368,24	0,91
US38373MLD01	0,283 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.03.44	0,00	-3.445.179,28	17.463.786,91	0,903500	120.843,46	0,07
US38373TAD72	0,596 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 20.10.31	0,00	-48.714,19	254.528,41	100,220630	195.366,45	0,12
US38373TTB16	0,748 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.11.27	0,00	-40.268,00	412.511,50	100,630540	317.923,37	0,20
US38373TW506	0,648 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.02.32	0,02	-6.085,19	82.800,78	100,440328	63.694,08	0,04
US38373V5Q90	0,548 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.12.26	0,00	-41.595,39	615.451,14	100,432338	473.395,09	0,29
US38373VHS25	0,498 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.08.32	0,00	-314.768,40	1.937.189,40	100,192199	1.486.492,04	0,92
US38373XGS99	0,448 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.06.32	0,02	-159.072,83	804.115,85	100,101290	616.474,18	0,38
US38373XMC73	0,596 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 20.06.32	0,01	-5.540,23	82.142,24	100,421641	63.175,75	0,04
US38373XZ824	0,448 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.07.32	0,00	-178.882,33	1.216.646,82	100,082289	932.563,36	0,58
US38374E7S09	0,207 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.01.44	0,00	-4.365.361,30	22.942.230,60	0,464900	81.686,77	0,05
US38374EJZ16	0,336 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.02.44	0,00	-3.931.165,70	47.771.666,60	1,559450	570.556,19	0,35
US38374FGU21	0,473 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.03.34	0,00	-1.444.893,91	10.652.755,67	1,429450	116.623,88	0,07
US38376GCX60	1,347 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.11.51	20.458.999,71	-342.573,25	27.757.612,90	5,640000	1.198.996,21	0,74
US38376GGH74	1,151 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.01.52	0,00	-77.521,36	7.638.990,72	5,741800	335.923,68	0,21
US3837H14N86	0,548 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.04.29	0,00	-42.269,71	413.056,69	100,198580	316.977,05	0,20
US3837H34Q71	1,368 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.01.30	0,00	-106.159,47	1.465.308,68	100,775610	1.130.944,13	0,70
US3837H3DL84	7,500 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 20.11.29	0,00	-91.260,60	890.506,32	116,276309	793.021,27	0,49
US3837H4PR00	1,368 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.02.30	0,00	-248.133,36	3.074.294,62	101,901330	2.399.285,51	1,48
US3837H4YT64	0,746 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 20.09.30	0,00	-892,96	11.039,76	100,030617	8.457,63	0,01

Summe USD 121.509.015,53 75,11

Devisenmittelkurs: 1,305700

strukturierte Produkte

Währung: USD

US07384M7C06	2,570 BEAR STEARNS ADJUSTABLE RATE 25.03.35	0,04	-89.370,73	997.490,54	94.847749	724.590,12	0,45
US07384M7D88	3,078 BEAR STEARNS ADJUSTABLE RATE 25.03.35	0,00	-34.871,18	296.446,03	97.573598	221.531,02	0,14
US07387ACJ25	2,220 BEAR STEARNS ADJUSTABLE RATE 25.08.35	0,02	-29.122,54	308.324,13	96.017895	226.733,81	0,14
US07387ACK97	2,250 BEAR STEARNS ADJUSTABLE RATE 25.08.35	0,01	-52.576,39	517.564,93	89.867247	356.223,75	0,22
US12558MBB72	0,514 CIT GROUP HOME EQUITY LOAN TRUST 25.06.33	0,00	0,00	5.997,93	82.320901	3.781,53	0,00
US152314EQ97	0,544 CENTEX HOME EQUITY 25.01.32	0,00	0,00	13.934,64	79.468074	8.480,96	0,01
US17307GXP89	2,230 CITIGROUP MORTGAGE LOAN TRUST INC 25.09.35	0,00	-28.744,87	406.347,75	93.009449	289.455,31	0,18
US22541NAD12	0,844 HOME EQUITY ASSET TRUST 25.11.32	0,00	0,00	1.282,98	71.030725	697,94	0,00
US22545RCM60	0,472 CREDIT SUISSE MORTGAGE CAPITAL 15.10.21	0,00	0,00	1.292.082,04	93.933249	929.535,60	0,57
US23247LAA61	0,304 COUNTRYWIDE ASSET-BACKED 25.06.47	0,02	-253.047,43	95.631,12	99.562492	72.920,83	0,05
US3133TMG268	0,544 FHLMC STRUCTURED PASS THROUGH 25.12.29	0,00	-3.792,05	113.067,45	92.641799	80.223,42	0,05
US3133TNGH17	0,524 FHLMC STRUCTURED PASS THROUGH 25.05.30	0,00	-3.051,69	70.600,59	94.447964	51.069,02	0,03
US3138A3UZ85	4,000 FANNIE MAE POOL 01.01.41	0,00	-32.570,17	820.193,21	104.953124	659.277,32	0,41
US3138A5N240	4,000 FANNIE MAE POOL 01.03.41	0,00	-26.336,49	283.185,09	104.953124	227.626,25	0,14
US31395HHV50	1,373 FHLMC STRUCTURED PASS THROUGH 25.10.44	0,00	-46.642,60	839.414,25	100.245229	644.461,00	0,40
US31410GN665	6,500 FANNIE MAE POOL 01.03.37	0,00	-31.632,74	283.369,10	112.078122	243.237,16	0,15
US31410K4E12	5,000 FANNIE MAE POOL 01.03.23	0,01	-68.193,98	324.894,65	108.015623	268.773,05	0,17
US31410SQE09	6,000 FANNIE MAE POOL 01.07.36	0,00	-36.655,43	198.522,09	109.921873	167.128,13	0,10
US31411CDW82	6,000 FANNIE MAE POOL 01.12.36	0,00	-1.120,61	8.515,32	109.921873	7.168,72	0,00
US31411KE417	6,000 FANNIE MAE POOL 01.03.37	0,00	-8.641,69	71.431,99	109.921875	60.135,85	0,04
US31411NZU44	5,000 FANNIE MAE POOL 01.02.22	0,01	-20.083,13	51.184,90	108.015619	42.343,33	0,03
US31415RU773	5,000 FANNIE MAE POOL 01.07.23	0,00	-30.335,53	97.816,31	108.015615	80.919,72	0,05
US31415YDH99	5,000 FANNIE MAE POOL 01.01.24	0,00	-538,46	18.046,43	108.015602	14.929,12	0,01
US31416XT839	4,000 FANNIE MAE POOL 01.03.41	0,00	-60.112,00	3.271.883,39	104.953125	2.629.963,88	1,63
US31417KPP65	4,500 FANNIE MAE POOL 01.03.39	0,00	-1.699,48	178.087,42	106.296875	144.980,74	0,09
US31417VKR32	4,000 FANNIE MAE POOL 01.12.39	759.770,43	0,00	759.770,43	104.953124	610.709,04	0,38
US31417YAG26	4,000 FANNIE MAE POOL 01.03.39	120.229,59	0,00	120.229,59	104.953123	96.641,42	0,06
US45660LCL18	0,564 INDYMAC INDEX MORTGAGE LOAN TRUST 25.02.35	0,01	-17.099,23	259.851,40	64.346746	128.058,45	0,08
US46625YT943	0,617 JP MORGAN CHASE COMMERCIAL MORTGAGE 15.07.19	0,05	-148.383,05	2.470.819,48	96.719950	1.830.263,73	1,13
US61910AAA60	0,660 MORTGAGE EQUITY CONVERSION ASSET 25.01.42	0,01	-6.045,15	910.653,01	88.250000	615.494,58	0,38
US61911AAA51	0,630 MORTGAGE EQUITY CONVERSION ASSET 25.10.41	0,00	0,00	771.883,11	88.499999	523.180,32	0,32
US61911CAA18	0,640 MORTGAGE EQUITY CONVERSION ASSET 25.02.42	0,00	-1.677,33	211.754,87	88.249998	143.121,44	0,09
US61911GAA22	0,620 MORTGAGE EQUITY CONVERSION ASSET 25.05.42	0,00	-67.676,73	4.107.000,51	88.000000	2.767.986,85	1,71
US74928WAW38	0,744 RBSP RESECURITIZATION TRUST 21.11.35	0,01	-132.079,93	1.308.429,07	97.677850	978.820,08	0,61
US75970NAA54	1,004 RENAISSANCE HOME EQUITY LOAN TRUST 25.12.32	0,01	0,00	21.727,52	68.531245	11.403,95	0,01
US7609856D82	8,500 RESIDENTIAL ASSET MORTGAGE PRODUCTS 25.10.31	0,04	-30.365,08	505.315,98	107.060398	414.332,00	0,26
US769423AA23	0,304 RIVERVIEW HECM TRUST 25.07.47	0,02	-42.654,10	1.539.770,53	88.000000	1.037.756,03	0,64
US84604KAD19	5,906 SOVEREIGN COMMERCIAL MORTGAGE 22.07.30	0,04	-366.436,84	2.558.881,69	103.011400	2.018.794,40	1,25
US86358RW452	0,824 AMORTIZING RESIDENTIAL COLLATERAL 25.07.32	0,00	0,00	6.344,06	79.468668	3.861,17	0,00
US92922FAS74	2,486 WAMU MORTGAGE PASS THROUGH 25.08.33	0,08	-105.372,79	1.118.113,08	100.402699	859.780,73	0,53
US939336X409	0,564 WAMU MORTGAGE PASS THROUGH 25.01.45	0,01	-13.745,65	299.387,42	81.820398	187.608,16	0,12

	Summe USD						20.383.999,93	12,60
	Devisenmittelkurs:	1,305700						
	nicht notierte Wertpapiere							
	Anleihen							
	Währung: USD							
US36225CMN38	2,250 GINNIE MAE II POOL 20.01.30	0,01	-1.249,90	20.523,88	103,261908	16.231,40	0,01	
US36225CMY92	2,000 GINNIE MAE II POOL 20.02.30	0,00	-439,70	19.616,46	103,186901	15.502,50	0,01	
US36225CQ748	1,625 GINNIE MAE II POOL 20.12.30	0,00	-16.397,18	151.107,41	103,378591	119.639,05	0,07	
US36225CTZ94	1,750 GINNIE MAE II POOL 20.01.32	0,01	-1.037,02	27.232,35	103,470248	21.580,28	0,01	
US36225CZD19	2,125 GINNIE MAE II POOL 20.09.33	0,00	-4.465,76	53.447,60	103,491083	42.363,10	0,03	
US36225CZF66	2,125 GINNIE MAE II POOL 20.08.33	0,00	-817,55	48.262,12	103,491091	38.253,03	0,02	
US383739DH97	0,648 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.02.31	0,00	-130.035,27	1.933.492,56	100,416989	1.486.984,00	0,92	
US3837H3AP26	0,698 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.12.18	0,00	-225.012,00	1.469.467,00	100,218649	1.127.885,41	0,70	
	Summe USD					2.868.438,77	1,77	
	Devisenmittelkurs:	1,305700						
	strukturierte Produkte							
	Währung: USD							
US16678RAS67	0,524 CC MORTGAGE FUNDING CORP 25.01.35	0,06	-5.024,82	96.882,34	69,195170	51.342,49	0,03	
	Summe USD					51.342,49	0,03	
	Devisenmittelkurs:	1,305700						
	Neuemissionen							
	Anleihen							
	Währung: USD							
US36176VEV18	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.41	184.062,00	-814,28	183.247,72	104,828120	147.120,42	0,09	
US3620A24F09	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.12.41	1.000.000,00	-2.638,86	997.361,14	107,796875	823.408,24	0,51	
US3620ACXP44	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.41	512.699,00	-2.431,73	510.267,27	104,828125	409.668,07	0,25	
US3620ANJE18	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.41	500.000,01	-2.279,18	497.720,83	104,828124	399.595,16	0,25	
US3620AWCZ19	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.41	999.999,00	-4.639,07	995.359,93	104,828125	799.124,72	0,49	
US38375BNA60	0,845 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 20.09.61	3.700.000,00	-75.986,49	3.624.013,51	99,308577	2.756.342,37	1,70	
US38375BNQ13	0,995 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 20.10.61	8.000.000,00	-38.881,52	7.961.118,48	99,508192	6.067.216,86	3,75	
	Summe USD					11.402.475,84	7,05	
	Devisenmittelkurs:	1,305700						
	Strips							
	Währung: USD							
US9127955R87	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 07.06.12	3.100.000,00	-1.600.000,00	1.500.000,00	99,981695	1.148.598,77	0,71	
US9127955Z04	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 07.02.13	2.000.000,00	0,00	2.000.000,00	99,819875	1.528.986,36	0,95	
	Summe USD					2.677.585,13	1,66	
	Devisenmittelkurs:	1,305700						
	strukturierte Produkte							
	Währung: USD							

US31417AL493	4,000 FANNIE MAE POOL 01.11.41	2.000.199,86	0,00	2.000.199,86	104,953124	1.607.775,32	0,99
	Summe USD					1.607.775,32	0,99
	Devisenmittelkurs: 1,305700						
Gesamtsumme Wertpapiere						160.500.633,01	99,21
Derivative Produkte							
Devisentermingeschäfte		Verkauf		Kauf		Kursdifferenz	Anteil
						EUR	in %
		-35.565.329,80	USD	26.845.000,00	EUR	-391.158,47	-0,24
		-71.388.921,08	USD	53.689.000,00	EUR	-981.095,24	-0,61
		-1.162.086,46	USD	886.000,00	EUR	-3.933,29	0,00
		-51.140.737,27	USD	38.942.000,00	EUR	-218.696,88	-0,14
		-51.066.774,73	USD	38.942.000,00	EUR	-165.264,77	-0,10
		-2.000.000,00	EUR	2.651.164,00	USD	30.278,45	0,02
		-500.000,00	EUR	673.240,00	USD	15.571,53	0,01
		-308.000,00	EUR	406.977,74	USD	3.666,18	0,00
Summe Devisentermingeschäfte						-1.710.632,49	-1,06
Forwards			Nominale	Kaufkurs	Börsekurs	Gewinn/Verlust	Anteil
							in %
Währung: USD							
US01F0326417	FNCL 3,5 12.04.12		500.000,00	103,093750	102,953125	-538,5	0,00
US01F0326417	FNCL 3,5 12.04.12		-500.000,00	102,859375	102,953125	-359,00	0,00
US01F0326581	FNCL 3,5 14.05.12		500.000,00	102,531250	102,640625	418,83	0,00
US01F0406441	FNCL 4,0 12.04.12		-3.895.000,00	105,281250	104,953125	9.788,20	0,01
US01F0406441	FNCL 4,0 12.04.12		2.000.000,00	105,125000	104,953125	-2.632,68	0,00
US01F0406441	FNCL 4,0 12.04.12		-2.000.000,00	105,234375	104,953125	4.308,03	0,00
US01F0424345	FNCL 4,5 15.03.12		1.000.000,00	106,625000	107,078125	3.470,36	0,00
US01F0424345	FNCL 4,5 15.03.12		-1.000.000,00	107,023437	107,078125	-418,84	0,00
US01F0424428	FNCL 4,5 17.04.12		1.000.000,00	106,890625	107,015625	957,34	0,00
US01F0426407	FNCL 4,5 12.04.12		-10.000.000,00	106,484375	106,296875	14.360,11	0,01
US01F0426407	FNCL 4,5 12.04.12		-4.000.000,00	106,515625	106,296875	6.701,38	0,00
US01F0426407	FNCL 4,5 12.04.12		4.000.000,00	106,484375	106,296875	-5.744,04	0,00
US01F0426407	FNCL 4,5 12.04.12		10.000.000,00	106,468750	106,296875	-13.163,43	-0,01
US01F0426407	FNCL 4,5 12.04.12		4.000.000,00	106,468750	106,296875	-5.265,37	0,00
US01F0506430	FNCL 5,0 12.04.12		8.000.000,00	107,906250	107,859375	-2.872,02	0,00
US01F0506430	FNCL 5,0 12.04.12		-8.000.000,00	107,875000	107,859375	957,34	0,00
US01F0506430	FNCL 5,0 12.04.12		2.000.000,00	107,714843	107,859375	2.213,86	0,00
US01F0506430	FNCL 5,0 12.04.12		-2.000.000,00	107,968750	107,859375	1.675,34	0,00
US01F0526495	FNCL 5,5 12.04.12		-4.000.000,00	108,761718	108,734375	837,65	0,00
US01F0526495	FNCL 5,5 12.04.12		4.000.000,00	108,671875	108,734375	1.914,68	0,00
US01F0526495	FNCL 5,5 12.04.12		3.000.000,00	108,750000	108,734375	-359,00	0,00
US01F0526495	FNCL 5,5 12.04.12		-3.000.000,00	108,765625	108,734375	718,00	0,00
US01F0606420	FNCL 6,0 12.04.12		-3.000.000,00	109,921875	109,921875	0,00	0,00

US01F0606420	FNCL 6,0 12.04.12	3.000.000,00	109,921875	109,921875	0,00	0,00
US01N0306462	GNSF 3,0 19.04.12	2.000.000,00	100,875000	100,515625	-5.504,71	0,00
US01N0306462	GNSF 3,0 19.04.12	-2.000.000,00	100,875000	100,515625	5.504,71	0,00
US01N0326346	GNSF 3,5 19.03.12	3.000.000,00	104,984375	104,828125	-3.590,02	0,00
US01N0326346	GNSF 3,5 19.03.12	2.000.000,00	105,125000	104,828125	-4.547,36	0,00
US01N0326346	GNSF 3,5 19.03.12	4.000.000,00	104,984375	104,828125	-4.786,70	0,00
US01N0326346	GNSF 3,5 19.03.12	2.000.000,00	104,984375	104,828125	-2.393,35	0,00
US01N0326346	GNSF 3,5 19.03.12	-2.000.000,00	105,156250	104,828125	5.026,03	0,00
US01N0326346	GNSF 3,5 19.03.12	-9.000.000,00	104,921875	104,828125	6.462,05	0,00
US01N0326429	GNSF 3,5 19.04.12	2.000.000,00	104,234375	104,515625	4.308,03	0,00
US01N0326429	GNSF 3,5 19.04.12	9.000.000,00	104,593750	104,515625	-5.385,04	0,00
US01N0326429	GNSF 3,5 19.04.12	3.000.000,00	104,906250	104,515625	-8.975,07	-0,01
US01N0406379	GNSF 4,0 19.03.12	7.000.000,00	106,812500	107,796875	52.773,41	0,03
US01N0406379	GNSF 4,0 19.03.12	-4.000.000,00	107,722656	107,796875	-2.273,69	0,00
US01N0406379	GNSF 4,0 19.03.12	-3.000.000,00	107,531250	107,796875	-6.103,04	0,00
US01N0406379	GNSF 4,0 19.03.12	3.000.000,00	107,656250	107,796875	3.231,02	0,00
US01N0406379	GNSF 4,0 19.03.12	-1.000.000,00	107,531250	107,796875	-2.034,34	0,00
US01N0406379	GNSF 4,0 19.03.12	-1.000.000,00	107,531250	107,796875	-2.034,34	0,00
US01N0406379	GNSF 4,0 19.03.12	1.000.000,00	107,593750	107,796875	1.555,67	0,00
US01N0406379	GNSF 4,0 19.03.12	-2.000.000,00	107,835937	107,796875	598,33	0,00
US01N0406452	GNSF 4,0 19.04.12	50.000,00	107,718750	107,546875	-65,81	0,00
US01N0406452	GNSF 4,0 19.04.12	-4.000.000,00	107,703125	107,546875	4.786,70	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	1.000.000,00	108,750000	108,921875	1.316,34	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	-8.000.000,00	109,000000	108,921875	4.786,70	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	2.000.000,00	109,140625	108,921875	-3.350,69	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	6.000.000,00	108,953125	108,921875	-1.436,01	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	1.000.000,00	109,031250	108,921875	-837,67	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	-2.000.000,00	109,109375	108,921875	2.872,02	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	2.000.000,00	108,906250	108,921875	239,33	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	1.000.000,00	108,968750	108,921875	-359	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	1.000.000,00	109,187500	108,921875	-2.034,34	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	6.000.000,00	108,992187	108,921875	-3.231,00	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	-4.000.000,00	109,468750	108,921875	16.753,46	0,01
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	4.000.000,00	108,992187	108,921875	-2.154,00	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	-4.000.000,00	109,054687	108,921875	4.068,68	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	2.000.000,00	108,687500	108,921875	3.590,02	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	-2.000.000,00	108,984375	108,921875	957,34	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	-1.000.000,00	108,984375	108,921875	478,67	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	-6.000.000,00	108,984375	108,921875	2.872,02	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	-2.000.000,00	108,984375	108,921875	957,34	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	13.000.000,00	108,687500	108,921875	23.335,18	0,01
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	2.000.000,00	108,976562	108,921875	-837,66	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	-4.000.000,00	108,984375	108,921875	1.914,68	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	12.000.000,00	108,687500	108,921875	21.540,17	0,01
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	-1.000.000,00	109,015625	108,921875	718,00	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	-2.000.000,00	109,015625	108,921875	1.436,01	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	-6.000.000,00	109,015625	108,921875	4.308,03	0,00

US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	-3.000.000,00	109,015625	108,921875	2.154,01	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	-5.000.000,00	109,125000	108,921875	7.778,39	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	-3.000.000,00	109,109375	108,921875	4.308,03	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	8.000.000,00	108,976562	108,921875	-3.350,66	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	-2.000.000,00	109,093750	108,921875	2.632,68	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	-2.000.000,00	108,984375	108,921875	957,34	0,00
US01N0426336	GNSF 4,5 19.03.12	-4.000.000,00	109,476562	108,921875	16.992,78	0,01
US01N0426419	GNSF 4,5 19.04.12	1.000.000,00	108,828125	108,796875	-239,33	0,00
US01N0426419	GNSF 4,5 19.04.12	-10.000.000,00	108,843750	108,796875	3.590,02	0,00
US01N0426419	GNSF 4,5 19.04.12	10.000.000,00	108,828125	108,796875	-2.393,35	0,00
US01N0426419	GNSF 4,5 19.04.12	2.000.000,00	108,859375	108,796875	-957,34	0,00
US01N0426419	GNSF 4,5 19.04.12	10.000.000,00	108,859375	108,796875	-4.786,70	0,00
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	5.000.000,00	110,429687	110,546875	4.487,55	0,00
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	16.000.000,00	110,546875	110,546875	0,00	0,00
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	10.000.000,00	110,828125	110,546875	-21.540,17	-0,01
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	4.000.000,00	110,515625	110,546875	957,34	0,00
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	-7.000.000,00	110,687500	110,546875	7.539,05	0,00
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	-5.000.000,00	110,671875	110,546875	4.786,70	0,00
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	-2.000.000,00	110,742187	110,546875	2.991,68	0,00
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	-7.000.000,00	110,855468	110,546875	16.544,00	0,01
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	8.000.000,00	111,042968	110,546875	-30.395,52	-0,02
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	-8.000.000,00	110,710937	110,546875	10.052,04	0,01
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	1.000.000,00	110,562500	110,546875	-119,66	0,00
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	8.000.000,00	110,421875	110,546875	7.658,72	0,00
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	-5.000.000,00	110,425781	110,546875	-4.637,12	0,00
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	-4.000.000,00	110,425781	110,546875	-3.709,70	0,00
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	-4.000.000,00	110,859375	110,546875	9.573,40	0,01
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	-1.000.000,00	111,031250	110,546875	3.709,69	0,00
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	-2.000.000,00	110,734375	110,546875	2.872,02	0,00
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	-6.000.000,00	110,859375	110,546875	14.360,11	0,01
US01N0506368	GNSF 5,0 19.03.12	-1.000.000,00	111,031250	110,546875	3.709,69	0,00
US01N0506442	GNSF 5,0 19.04.12	10.000.000,00	110,562500	110,359375	-15.556,78	-0,01
US01N0506442	GNSF 5,0 19.04.12	7.000.000,00	110,562500	110,359375	-10.889,75	-0,01
US01N0506442	GNSF 5,0 19.04.12	8.000.000,00	110,468750	110,359375	-6.701,38	0,00
US01N0506442	GNSF 5,0 19.04.12	9.000.000,00	110,203125	110,359375	10.770,08	0,01
US01N0506442	GNSF 5,0 19.04.12	-5.000.000,00	110,472656	110,359375	4.337,94	0,00
US01N0506517	GNSF 5,0 21.05.12	5.000.000,00	110,265625	110,140625	-4.786,70	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	7.000.000,00	111,656250	111,484375	-9.214,40	-0,01
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	3.000.000,00	111,578125	111,484375	-2.154,01	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	-5.000.000,00	111,796875	111,484375	11.966,76	0,01
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	1.000.000,00	111,593750	111,484375	-837,67	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	6.000.000,00	111,562500	111,484375	-3.590,02	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	1.000.000,00	111,570312	111,484375	-658,16	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	1.000.000,00	111,828125	111,484375	-2.632,68	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	-8.000.000,00	111,914062	111,484375	26.326,84	0,02
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	3.000.000,00	111,625000	111,484375	-3.231,02	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	-3.000.000,00	111,937500	111,484375	10.411,08	0,01

US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	-1.000.000,00	111,937500	111,484375	3.470,36	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	-3.000.000,00	111,937500	111,484375	10.411,08	0,01
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	-1.000.000,00	111,921875	111,484375	3.350,69	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	-1.000.000,00	111,921875	111,484375	3.350,69	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	3.000.000,00	111,625000	111,484375	-3.231,02	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	-3.000.000,00	111,796875	111,484375	7.180,05	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	-4.000.000,00	111,296875	111,484375	-5.744,04	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	-1.000.000,00	111,921875	111,484375	3.350,69	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	-2.000.000,00	111,515625	111,484375	478,67	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	2.000.000,00	111,234375	111,484375	3.829,36	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	-1.000.000,00	111,921875	111,484375	3.350,69	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	1.000.000,00	111,234375	111,484375	1.914,68	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	-1.000.000,00	111,679687	111,484375	1.495,84	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	1.000.000,00	111,234375	111,484375	1.914,68	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	5.000.000,00	111,625000	111,484375	-5.385,04	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	4.000.000,00	111,625000	111,484375	-4.308,03	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 19.03.12	-4.000.000,00	111,796875	111,484375	9.573,40	0,01
US01N0526408	GNSF 5,5 19.04.12	8.000.000,00	111,695312	111,296875	-24.412,16	-0,02
US01N0526408	GNSF 5,5 19.04.12	7.000.000,00	111,718750	111,296875	-22.617,17	-0,01
US01N0526408	GNSF 5,5 19.04.12	3.000.000,00	111,609375	111,296875	-7.180,05	0,00
US01N0526408	GNSF 5,5 19.04.12	1.000.000,00	111,468750	111,296875	-1.316,34	0,00
US01N0526408	GNSF 5,5 19.04.12	1.000.000,00	111,718750	111,296875	-3.231,02	0,00
US01N0526408	GNSF 5,5 19.04.12	-1.000.000,00	111,046875	111,296875	-1.914,68	0,00
US01N0526408	GNSF 5,5 19.04.12	3.000.000,00	111,718750	111,296875	-9.693,07	-0,01
US01N0526408	GNSF 5,5 19.04.12	-3.000.000,00	111,046875	111,296875	-5.744,04	0,00
US01N0526408	GNSF 5,5 19.04.12	-8.000.000,00	111,242187	111,296875	-3.350,72	0,00
US01N0526408	GNSF 5,5 19.04.12	-3.000.000,00	111,406250	111,296875	2.513,01	0,00
US01N0526408	GNSF 5,5 19.04.12	-7.000.000,00	111,406250	111,296875	5.863,71	0,00
US01N0526408	GNSF 5,5 19.04.12	3.000.000,00	111,281250	111,296875	359	0,00
US01N0526572	GNSF 5,5 21.05.12	8.000.000,00	111,011718	111,140625	7.898,10	0,00
US01N0526572	GNSF 5,5 21.05.12	10.000.000,00	111,187500	111,140625	-3.590,02	0,00
US01N0606358	GNSF 6,0 19.03.12	3.000.000,00	113,171875	112,546875	-14.360,11	-0,01
US01N0606358	GNSF 6,0 19.03.12	1.000.000,00	112,437500	112,546875	837,67	0,00
US01N0606358	GNSF 6,0 19.03.12	2.000.000,00	112,437500	112,546875	1.675,34	0,00
US01N0606358	GNSF 6,0 19.03.12	-2.000.000,00	112,375000	112,546875	-2.632,68	0,00
US01N0606358	GNSF 6,0 19.03.12	-5.000.000,00	112,031250	112,546875	-19.745,15	-0,01
US01N0606358	GNSF 6,0 19.03.12	1.000.000,00	112,546875	112,546875	0,00	0,00
US01N0606358	GNSF 6,0 19.03.12	1.500.000,00	112,546875	112,546875	0,00	0,00
US01N0606358	GNSF 6,0 19.03.12	-1.500.000,00	111,984375	112,546875	-6.462,05	0,00
US01N0606432	GNSF 6,0 19.04.12	2.000.000,00	112,234375	112,453125	3.350,69	0,00
US01N0606432	GNSF 6,0 19.04.12	5.000.000,00	111,875000	112,453125	22.138,50	0,01
US01N0606432	GNSF 6,0 19.04.12	1.500.000,00	111,859375	112,453125	6.821,05	0,00
US01N0606432	GNSF 6,0 19.04.12	-3.000.000,00	112,406250	112,453125	-1.077,00	0,00
US01N0626315	GNSF 6,5 19.03.12	-1.000.000,00	113,546875	114,453125	-6.940,72	0,00
US01N0626315	GNSF 6,5 19.03.12	1.000.000,00	113,781250	114,453125	5.145,70	0,00
US01N0626497	GNSF 6,5 19.04.12	-1.000.000,00	113,562500	114,234375	-5.145,70	0,00
US21H0406320	G2SF 4,0 19.03.12	1.140.000,00	107,312500	107,859375	4.774,73	0,00

US21H0406320	G2SF 4,0 19.03.12		2.000.000,00	107,312500	107,859375	8.376,73	0,01
US21H0406320	G2SF 4,0 19.03.12		-2.000.000,00	107,890625	107,859375	478,67	0,00
US21H0406320	G2SF 4,0 19.03.12		-1.140.000,00	107,941406	107,859375	716,20	0,00
US21H0406403	G2SF 4,0 19.04.12		2.000.000,00	107,609375	107,578125	-478,67	0,00
US21H0406403	G2SF 4,0 19.04.12		1.140.000,00	107,656250	107,578125	-682,10	0,00
US21H0426385	G2SF 4,5 19.03.12		6.000.000,00	108,546875	109,015625	21.540,17	0,01
US21H0426385	G2SF 4,5 19.03.12		-6.000.000,00	108,531250	109,015625	-22.258,17	-0,01
US21H0426385	G2SF 4,5 19.03.12		300.000,00	109,156250	109,015625	-323,09	0,00
US21H0426385	G2SF 4,5 19.03.12		-6.000.000,00	108,664062	109,015625	-16.155,15	-0,01
US21H0426385	G2SF 4,5 19.03.12		-3.000.000,00	108,531250	109,015625	-11.129,08	-0,01
US21H0426385	G2SF 4,5 19.03.12		9.000.000,00	109,156250	109,015625	-9.693,07	-0,01
US21H0426385	G2SF 4,5 19.03.12		-300.000,00	108,531250	109,015625	-1.112,90	0,00
US21H0426385	G2SF 4,5 19.03.12		-200.000,00	109,156250	109,015625	215,40	0,00
US21H0426385	G2SF 4,5 19.03.12		200.000,00	109,179687	109,015625	-251,29	0,00
US21H0426385	G2SF 4,5 19.03.12		-5.800.000,00	108,531250	109,015625	-21.516,23	-0,01
US21H0426385	G2SF 4,5 19.03.12		5.800.000,00	109,175781	109,015625	-7.114,22	0,00
US21H0426468	G2SF 4,5 19.04.12		-200.000,00	109,015625	108,890625	191,46	0,00
US21H0426468	G2SF 4,5 19.04.12		-5.800.000,00	109,015625	108,890625	5.552,57	0,00
	Summe USD					93.834,96	0,06
	Devisenmittelkurs:	1,305700					
	Summe Forwards					93.834,96	0,06
	Gesamtsumme Derivative Produkte					-1.616.797,53	-1,00

Während des Berichtszeitraumes getätigte Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, soweit sie nicht in der Vermögensaufstellung genannt wurden:

Währung: EUR

XS0274972842	1,785 SLM CORP 15.11.11	0,00	-700.000,00
--------------	-------------------------	------	-------------

Währung: USD

US06424HBF38	0,488 BANC OF AMERICA LARGE LOAN INC 15.03.22	0,02	-152.832,06
US3138A2BE84	3,500 FANNIE MAE POOL 01.12.40	6.451.218,51	-9.428.981,06
US3138A2BQ15	4,000 FANNIE MAE POOL 01.12.40	0,01	-1.248.781,51
US3138A2F797	4,000 FANNIE MAE POOL 01.11.40	0,00	-378.343,92
US3138A2YM53	4,000 FANNIE MAE POOL 01.01.41	0,01	-1.957.222,91
US3138A4J894	4,000 FANNIE MAE POOL 01.02.41	0,00	-24.906,53
US3138A4WH43	4,000 FANNIE MAE POOL 01.01.41	0,00	-297.959,69
US3138A5NE87	4,000 FANNIE MAE POOL 01.02.41	0,00	-346.998,57
US3138A5X231	4,000 FANNIE MAE POOL 01.02.41	0,00	-388.362,39
US3138A6EQ91	4,000 FANNIE MAE POOL 01.01.41	0,00	-237.282,76
US3138A7FR49	4,000 FANNIE MAE POOL 01.02.41	81.393,23	-10.990.639,52
US3138A7M966	4,000 FANNIE MAE POOL 01.02.41	0,00	-305.788,35
US3138A8F430	4,000 FANNIE MAE POOL 01.03.41	0,00	-284.194,55
US3138A9NB60	4,000 FANNIE MAE POOL 01.03.41	0,01	-3.486.816,08
US3138ADKT15	4,000 FANNIE MAE POOL 01.08.41	0,00	-401.839,00
US3138ADP580	4,000 FANNIE MAE POOL 01.07.41	0,01	-280.990,78
US3138AJVJ83	4,000 FANNIE MAE POOL 01.09.41	0,00	-1.000.000,00

US3138AY5B11	3,500 FANNIE MAE POOL 01.12.41	17.548.784,74	-17.548.784,74
US31410WNC81	4,500 FANNIE MAE POOL 01.06.37	0,00	-291.530,37
US31416N7J56	5,000 FANNIE MAE POOL 01.05.24	0,00	-16.890,56
US31416NJB91	4,000 FANNIE MAE POOL 01.12.40	0,00	-850.647,48
US31416XBP42	4,000 FANNIE MAE POOL 01.11.40	78.743,24	-78.743,24
US31416YYQ50	4,000 FANNIE MAE POOL 01.04.41	0,00	-999.999,46
US31417MUU51	5,000 FANNIE MAE POOL 01.10.24	0,00	-960.036,03
US31419AK228	4,000 FANNIE MAE POOL 01.09.40	0,00	-233.213,79
US31419B5X91	4,000 FANNIE MAE POOL 01.09.40	0,00	-290.285,54
US31419BBT17	4,000 FANNIE MAE POOL 01.02.41	0,02	-5.000.000,77
US31419CBD48	4,000 FANNIE MAE POOL 01.08.40	0,00	-1.972.673,50
US31419D5F40	4,000 FANNIE MAE POOL 01.09.40	0,00	-609.030,30
US31419EQM48	4,000 FANNIE MAE POOL 01.11.40	1.871,86	-1.205.692,97
US31419FW289	4,000 FANNIE MAE POOL 01.11.40	0,00	-896.348,86
US31419JDU97	4,000 FANNIE MAE POOL 01.11.40	0,00	-897.103,84
US31419LZX45	4,000 FANNIE MAE POOL 01.12.40	0,00	-78.744,57
US36176AFG94	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.04.41	239.301,45	-239.301,45
US36176DKQ50	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.04.41	49.478,13	-49.478,13
US36176PRN86	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.41	4.000.000,00	-4.000.000,00
US36200A4C07	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.08.35	0,00	-94.156,96
US36200JKX71	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.36	0,00	-2.055,89
US36202FB395	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.10.39	0,00	-164.306,64
US36202FDV58	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.01.40	366.823,77	-366.823,77
US36202FPG53	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.01.41	275.009,41	-275.009,41
US36202FSD95	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.04.41	468.598,26	-468.598,26
US36202FSE78	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.04.41	20.575.666,41	-20.575.666,41
US36202FTK20	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.05.41	473.965,73	-473.965,73
US36202FTL03	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.05.41	1.597.074,82	-1.597.074,82
US36202FUF16	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.06.41	7.999.997,36	-13.975.021,12
US36202FVG89	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.07.41	206.274,82	-206.274,82
US36202FXB74	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.09.41	9.000.000,00	-9.000.000,00
US36202FXC57	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.09.41	6.707.181,97	-6.707.181,97
US3620A2XJ07	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.06.39	0,00	-392.235,86
US3620A85D15	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.39	0,00	-102.006,67
US3620ADUU49	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.40	0,01	-302.124,76
US3620AK4X12	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.40	0,00	-543.261,34
US3620AL2Z69	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.40	0,00	-917.251,72
US3620AL4E13	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.40	0,00	-182.365,77
US3620AL5A81	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.02.41	0,00	-4.186.526,85
US3620AMRZ71	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.40	5.803.872,58	-6.737.568,71
US3620AMTS11	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.41	0,00	-4.955.057,53
US3620AMVD14	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.02.41	0,00	-6.035.270,07
US3620ANYW41	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.40	196.131,00	-196.131,00
US3620APMX00	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.40	0,00	-699.370,62
US3620AQY235	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.02.40	765.818,74	-765.818,74
US3620ARLT62	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.40	806.318,76	-806.318,76
US3620ARLU36	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.10.40	235.848,61	-235.848,61

US3620ARMA62	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.10.40	726.160,63	-726.160,63
US3620ARQP95	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.40	490.757,65	-987.120,38
US3620ARUX73	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.40	82.395,14	-82.395,14
US3620ARVQ14	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.40	44.144,52	-44.144,52
US3620ARX979	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.41	0,00	-5.591.141,11
US3620ARYJ44	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.41	960.207,56	-960.207,56
US3620AS3F42	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.41	111.286,62	-111.286,62
US3620ASAL39	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.03.41	897.523,50	-897.523,50
US3620AT6H52	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.40	0,00	-3.756.596,40
US3620ATT312	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.41	303.239,01	-303.239,01
US3620AU5Z34	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.02.41	91.608,04	-91.608,04
US3620AUJA203	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.41	0,00	-2.128.573,20
US3620AUGL21	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.40	112.471,08	-1.109.407,55
US3620AVXS63	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.40	0,00	-995.232,38
US3620AWSV31	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.40	0,00	-4.347.788,40
US3620C53E51	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.40	0,00	-361.132,70
US3620C5LA37	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.41	50.180,56	-50.180,56
US3620C6BP98	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.40	0,00	-718.212,32
US36228FNB84	6,000 GSR MORTGAGE LOAN TRUST 25.03.32	0,01	-30.184,73
US36230K5R88	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.40	0,00	-624.401,17
US36230PV641	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.41	0,00	-179.410,99
US36230QJB59	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.40	907.100,33	-907.100,33
US36230RVV58	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.40	0,00	-3.983.302,11
US36230RYJ93	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.40	121.710,45	-121.710,45
US36230TK273	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.02.41	417.646,66	-417.646,66
US36230UEX37	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.41	0,00	-4.859.620,10
US36241KZ277	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.38	236.074,63	-236.074,63
US36294TYJ86	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.08.36	0,00	-42.967,26
US36294TYU32	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.09.36	0,01	-29.516,47
US36295HA421	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.08.39	0,00	-112.220,04
US36296QJC42	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.02.39	263.975,19	-263.975,19
US36296QME60	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.03.39	1.999.999,56	-1.999.999,56
US36296QZF98	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.05.39	0,00	-228.101,63
US36296YK357	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.09.40	227.604,97	-227.604,97
US36297CF468	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.40	0,00	-55.567,69
US36297GP203	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.40	38.368,20	-38.368,20
US38373RBE80	0,600 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.05.31	0,01	-1.536.300,87
US466309AC56	0,757 JP MORGAN ALTERNATIVE LOAN TRUST 27.06.37	0,01	-1.638.827,12
US59023AAB26	0,346 MERRILL LYNCH MORTGAGE INVESTORS 25.07.37	0,01	-49.449,85
US9127952T70	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 15.12.11	1.100.000,00	-1.100.000,00
US9127952Y65	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 12.01.12	23.900.000,00	-23.900.000,00
US9127953C37	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 09.02.12	700.000,00	-700.000,00
US9127953G41	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 08.03.12	52.800.000,00	-52.800.000,00
US9127953H24	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 05.04.12	2.800.000,00	-2.800.000,00
US9127953X73	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 08.12.11	11.000.000,00	-11.000.000,00
US9127953Y56	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 22.12.11	8.200.000,00	-8.200.000,00
US9127953Z22	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 29.12.11	6.800.000,00	-6.800.000,00

US9127954A61	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 05.01.12	5.610.000,00	-5.610.000,00
US9127955D91	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 15.03.12	1.200.000,00	-1.200.000,00
US9127955E74	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 22.03.12	39.200.000,00	-39.200.000,00
US9127955F40	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 29.03.12	1.300.000,00	-1.300.000,00
US9127955H06	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 12.04.12	2.100.000,00	-2.100.000,00
US9127955J61	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 19.04.12	7.700.000,00	-7.700.000,00
US9127955M90	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 10.05.12	25.700.000,00	-25.700.000,00
US9127955N73	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 17.05.12	3.700.000,00	-3.700.000,00
US9127955P22	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 24.05.12	2.900.000,00	-2.900.000,00
US912795Y629	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 19.01.12	0,00	-3.800.000,00
US912795Y702	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 26.01.12	13.100.000,00	-13.100.000,00
US912795Y884	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 02.02.12	1.190.000,00	-1.190.000,00
US912795Z204	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 16.02.12	7.400.000,00	-7.400.000,00
US912795Z386	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 23.02.12	8.200.000,00	-8.200.000,00
US912795Z469	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 01.03.12	9.700.000,00	-11.000.000,00
US912828SF82	2,000 UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 15.02.22	400.000,00	-400.000,00