

Allianz PIMCO Corporate

ISIN: AT0000706494 (A)

ISIN: AT0000706502 (T)

Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH

# Halbjahresbericht

vom 15.09.2019 – 14.03.2020

[www.allianzinvest.at](http://www.allianzinvest.at)



## Allgemeines zur **Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH**

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) RA Dr. Corvin Hummer Dkfm. Reinhard Pinzer Wolfgang Jerabek (Mitarbeitervertreter) Mag. Daniel Planer (Mitarbeitervertreter)
Geschäftsführung	Michael Bode Mag. Christian Ramberger
Prokuristen	Mag. Doris Kals Mag. Anton Kuzmanoski Mag. Jan Fellmayer
Staatskommissär Staatskommissärstellvertreter	Mag. Heidrun Zanetta AD Thomas Galee
Prüfer	KPMG Austria GmbH Wirtschaftsprüfungs- und Steuerberatungsgesellschaft
Depotbank	Allianz Investmentbank AG

## Zusammensetzung des Fondsvermögens per 14. März 2020

<u>1. Wertpapiere</u>	EUR	%
<b>Amtlich notierte Wertpapiere</b>		
Anleihen		
USD	105.552.674,72	77,06
Zerobonds		
USD	248,78	0,00
<b>Nicht notierte Wertpapiere</b>		
Anleihen		
USD	529.361,34	0,39
Strips		
USD	6.873.845,92	5,02
<b>Neuemissionen</b>		
Anleihen		
USD	14.681.608,83	10,72
Strips		
USD	21.531.076,11	15,71
<b>Summe Wertpapiere</b>	<b>149.168.815,70</b>	<b>108,90</b>
 <u>2. Bankguthaben / -verbindlichkeiten</u>		
EUR	480.796,62	0,35
Fremdwährung	-13.989.270,79	-10,21
<b>Summe Bankguthaben / -verbindlichkeiten</b>	<b>-13.508.474,17</b>	<b>-9,86</b>
 <u>3. Abgrenzungen</u>		
Anteilige Erträge (aus Wertpapieren/Bankguthaben und Aufwendungen)	<b>1.319.252,66</b>	<b>0,96</b>
<b>Fondsvermögen</b>	<b>136.979.594,19</b>	<b>100,00</b>

## Darstellung der Fondsdaten zum Berichtsstichtag:

Fondsdaten in EUR	per 14.09.2019	per 14.03.2020
Fondsvolumen gesamt	132.332.961,51	136.979.594,19
Errechneter Wert je Ausschüttungsanteil	48,05	46,60
Ausgabepreis je Ausschüttungsanteil	49,97	48,46
Errechneter Wert je Thesaurierungsanteil	84,04	82,37
Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil	87,40	85,66
<b>Ausschüttung/Auszahlung in EUR</b>		<b>per 15.11.2019</b>
Ausschüttung je Ausschüttungsanteil		1,0000
Auszahlung je Thesaurierungsanteil		0,8877

## Umlaufende Anteile zum Berichtsstichtag:

Ausschüttungsanteile	2.551.313
Thesaurierungsanteile	219.468
<b>Gesamt umlaufende Anteile per 14.03.2020</b>	<b>2.770.781</b>

## 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 %
14.09.16	134.868.158,29	44,77	1,28	2.521.166	6,00
14.09.17	116.341.060,06	42,06	1,0000	2.500.255	-3,35
14.09.18	107.391.019,42	41,73	0,7000	2.452.206	1,59
14.09.19	132.332.961,51	48,05	1,0000-	2.498.776	17,08
14.03.20	136.979.594,19	46,60	-	2.551.313	-

Datum	Errechneter Wert je Thesaurierungs- anteil	Zur Thesaurierung verwendeter Betrag	Auszahlung je Anteil	Anteile	Wertent- wicklung in %
14.09.16	75,07	3,87	1,10	292.876	6,04
14.09.17	71,48	4,52	0,8411	156.329	-3,39
14.09.18	71,77	-0,17	0,0000	70.385	1,58
14.09.19	84,04	2,92	0,8877	146.011	17,10
14.03.20	82,37	-	-	219.468	-

## **Anteilswertermittlung und Wertpapierbewertung**

Der Wert eines Anteiles ergibt sich aus der Teilung des Gesamtwertes des Investmentfonds einschließlich der Erträge durch die Zahl der Anteile. Der Gesamtwert des Investmentfonds 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, welcher bei der letzten Preisberechnung vor dem Stichtag verwendet wurde.
- 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.

## **Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps**

Wertpapierleihegeschäfte im Sinne der VO (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen laut Prospekt für den Fonds nicht eingesetzt werden. Wertpapierleihegeschäfte wurden deshalb nicht eingesetzt.

Pensionsgeschäfte im Sinne der VO (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen laut Prospekt für den Fonds eingesetzt werden. Im Rechnungsjahr wurden keine Pensionsgeschäfte durchgeführt.

Total Return Swaps (Gesamtrendite-Swaps) im Sinne der VO (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen laut Prospekt für den Fonds nicht eingesetzt werden. Total Return Swaps wurden deshalb nicht eingesetzt.

## Vermögensaufstellung des Allianz PIMCO Corporate per 14. März 2020

ISIN	Zugang	Abgang	Stand am 13.03.2020	Tageskurs	Kurswert EUR	Anteil in %
Amtlich notierte Wertpapiere						
Anleihen						
Währung: USD						
US00135TAB08	4,263 AIB GROUP PLC 10.04.25	0,00	0,00	200.000,00	104,61	186.142,35 0,14
US00203QAB32	3,750 AP MOLLER - MAERSK A/S 22.09.24	0,00	0,00	200.000,00	101,52	180.635,23 0,13
US00205GAD97	4,250 APT PIPELINES LTD 15.07.27	0,00	0,00	250.000,00	112,46	250.140,12 0,18
US00206RBK77	4,350 AT&T INC 15.06.45	0,00	0,00	700.000,00	103,91	647.104,54 0,47
US00206RHA32	5,150 AT&T INC 15.11.46	800.000,00	0,00	800.000,00	111,14	791.010,67 0,58
US00287YBD04	4,875 ABBVIE INC 14.11.48	0,00	-150.000,00	450.000,00	115,14	460.983,76 0,34
US00774MAE57	3,875 AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP 23.01.28	0,00	0,00	150.000,00	86,39	115.293,82 0,08
US00774MAH88	4,450 AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP 16.12.21	0,00	0,00	150.000,00	101,21	135.072,73 0,10
US00774MAL90	4,450 AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP 03.04.26	0,00	0,00	200.000,00	98,41	175.105,87 0,13
US009089AB93	5,375 AIR CANADA 2013-1 CLASS B PASS 15.05.21	0,00	-19.206,35	269.523,80	103,04	247.085,46 0,18
US00908PAC14	3,700 AIR CANADA 2017-1 CLASS B PASS 15.01.26	1,59	-14.684,13	255.952,38	103,02	234.589,23 0,17
US00912XBA19	3,250 AIR LEASE CORP 01.03.25	0,00	0,00	300.000,00	98,48	262.833,63 0,19
US01748NAE40	3,550 ALLEGION US HOLDING CO INC 01.10.27	0,00	0,00	100.000,00	109,78	97.669,03 0,07
US02109TAD46	4,650 ALROSA FINANCE SA 09.04.24	0,00	0,00	300.000,00	103,55	276.368,33 0,20
US023135BF28	3,875 AMAZON.COM INC 22.08.37	500.000,00	0,00	500.000,00	115,82	515.222,42 0,38
US023771R919	3,000 AMERICAN AIRLINES 2016-3 CLASS AA 15.10.28	0,00	-2.511,77	87.186,03	104,63	81.162,13 0,06
US023772AB21	4,000 AMERICAN AIRLINES 2013-1 CLASS A 15.07.25	0,00	-5.688,45	169.022,05	106,00	159.399,52 0,12
US02378MAA99	3,500 AMERICAN AIRLINES 2019-1 CLASS A 15.02.32	0,00	-1.539,66	98.460,34	100,78	88.278,80 0,06
US025932AK06	3,500 AMERICAN FINANCIAL GROUP INC/OH 15.08.26	0,00	0,00	300.000,00	108,02	288.305,60 0,21
US02666TAB35	4,900 AMERICAN HOMES 4 RENT LP 15.02.29	0,00	0,00	100.000,00	110,59	98.388,79 0,07
US03027XAK63	3,375 AMERICAN TOWER CORP 15.10.26	0,00	0,00	300.000,00	104,15	277.968,42 0,20
US03027XAM20	3,125 AMERICAN TOWER CORP 15.01.27	0,00	0,00	100.000,00	101,41	90.217,97 0,07
US03027XAT72	3,375 AMERICAN TOWER CORP 15.05.24	0,00	0,00	800.000,00	104,16	741.348,75 0,54
US03027XAW02	3,800 AMERICAN TOWER CORP 15.08.29	300.000,00	0,00	400.000,00	105,05	373.825,62 0,27
US031162BZ23	4,400 AMGEN INC 01.05.45	0,00	0,00	200.000,00	110,56	196.725,98 0,14
US031162CF59	4,663 AMGEN INC 15.06.51	0,00	0,00	900.000,00	116,50	932.805,16 0,68
US03522AAJ97	4,900 ANHEUSER-BUSCH COS LLC / ANHEUSER 01.02.46	0,00	0,00	500.000,00	110,15	489.971,09 0,36
US03523TBV98	5,550 ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 23.01.49	0,00	0,00	100.000,00	121,27	107.891,01 0,08
US035240AN09	4,600 ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 15.04.48	0,00	0,00	400.000,00	106,34	378.428,83 0,28
US035240AQ30	4,750 ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 23.01.29	0,00	0,00	300.000,00	112,91	301.365,21 0,22
US037833CD08	3,850 APPLE INC 04.08.46	0,00	0,00	600.000,00	113,53	606.029,36 0,44
US03938LBB99	3,600 ARCELORMITTAL SA 16.07.24	0,00	0,00	100.000,00	94,43	84.014,68 0,06
US042735BF63	3,875 ARROW ELECTRONICS INC 12.01.28	0,00	0,00	500.000,00	104,36	464.232,65 0,34
US042735BG47	3,250 ARROW ELECTRONICS INC 08.09.24	0,00	-100.000,00	100.000,00	100,83	89.705,95 0,07
US04621XAL29	3,197 ASSURANT INC 26.03.21	0,00	0,00	18.000,00	99,84	15.988,13 0,01
US05329WAM47	4,500 AUTONATION INC 01.10.25	0,00	0,00	500.000,00	107,78	479.443,95 0,35
US05351WAB90	3,800 AVANGRID INC 01.06.29	0,00	0,00	800.000,00	107,12	762.419,93 0,56
US05367AAH68	4,875 AVIATION CAPITAL GROUP LLC 01.10.25	500.000,00	0,00	500.000,00	108,27	481.625,89 0,35
US05401AAD37	5,250 AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD 15.05.24	150.000,00	0,00	150.000,00	101,86	135.938,17 0,10
US054561AJ49	4,350 EQUITABLE HOLDINGS INC 20.04.28	0,00	0,00	100.000,00	105,81	94.138,35 0,07
US05463CAC64	3,250 AXIS BANK LTD/DUBAI 21.05.20	0,00	0,00	200.000,00	100,26	178.399,47 0,13
US05526DBB01	3,557 BAT CAPITAL CORP 15.08.27	0,00	-400.000,00	400.000,00	98,33	349.932,38 0,26
US05533UAD00	4,375 BBVA BANCOMER SA/TEXAS 10.04.24	0,00	0,00	300.000,00	104,69	279.425,71 0,20
US05541TAH41	5,125 BGC PARTNERS INC 27.05.21	0,00	0,00	800.000,00	103,01	733.138,79 0,54
US056752AN88	4,875 BAIDU INC 14.11.28	0,00	0,00	400.000,00	115,88	412.398,58 0,30
US05723KAF75	4,080 BAKER HUGHES A GE CO LLC / BAKER 15.12.47	0,00	0,00	700.000,00	83,43	519.560,05 0,38
US05971BAD10	5,500 BANCO BTG PACTUAL SA/CAYMAN ISLANDS 31.01.23	0,00	0,00	200.000,00	98,56	175.377,22 0,13
US05971KAC36	3,306 BANCO SANTANDER SA 27.06.29	0,00	0,00	200.000,00	102,10	181.664,59 0,13
US06051GGT04	3,093 BANK OF AMERICA CORP 01.10.25	0,00	0,00	600.000,00	102,79	548.717,08 0,40
US06051GHG73	3,970 BANK OF AMERICA CORP 05.03.29	0,00	0,00	500.000,00	106,96	475.796,26 0,35
US06051GKH85	2,766 BANK OF AMERICA CORP 23.07.24	0,00	0,00	400.000,00	99,68	354.715,30 0,26
US06279JAA79	4,500 BANK OF IRELAND GROUP PLC 25.11.23	0,00	0,00	300.000,00	106,32	283.780,25 0,21
US067316AD11	2,750 BACARDI LTD 15.07.26	0,00	0,00	300.000,00	101,72	271.494,66 0,20
US067316AE93	4,450 BACARDI LTD 15.05.25	0,00	0,00	400.000,00	108,69	386.802,49 0,28
US06738EAE59	3,650 BARCLAYS PLC 16.03.25	0,00	0,00	325.000,00	102,19	295.472,42 0,22
US06738EAQ89	3,200 BARCLAYS PLC 10.08.21	0,00	0,00	500.000,00	99,29	441.692,62 0,32
US06738EBD67	4,972 BARCLAYS PLC 16.05.29	0,00	0,00	600.000,00	108,27	577.953,74 0,42
US06738EBE41	4,610 BARCLAYS PLC 15.02.23	0,00	0,00	200.000,00	103,04	183.339,86 0,13
US06738EBF16	3,122 BARCLAYS PLC 15.02.23	0,00	0,00	200.000,00	97,59	173.645,91 0,13
US09256BAM90	3,500 BLACKSTONE HOLDINGS FINANCE CO LLC 10.09.49	0,00	0,00	300.000,00	101,02	269.615,66 0,20
US09659DAB29	3,460 LELAND STANFORD JUNIOR UNIVERSITY 01.05.47	0,00	0,00	750.000,00	126,58	844.630,78 0,62
US097751BP56	8,750 BOMBARDIER INC 01.12.21	100.000,00	0,00	100.000,00	99,68	88.679,27 0,06
US101137AR84	3,850 BOSTON SCIENTIFIC CORP 15.05.25	0,00	-147.000,00	153.000,00	107,79	146.728,91 0,11
US101137AW79	3,750 BOSTON SCIENTIFIC CORP 01.03.26	200.000,00	0,00	200.000,00	108,98	193.914,59 0,14
US105340AQ63	3,950 BRANDYWINE OPERATING PARTNERSHIP LP 15.11.27	300.000,00	0,00	300.000,00	110,45	294.782,03 0,22
US10553YAF25	6,450 BRASKEM FINANCE LTD 03.02.24	0,00	0,00	400.000,00	104,94	373.464,41 0,27
US10922NAF06	4,700 BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC 22.06.47	0,00	0,00	100.000,00	82,18	73.112,99 0,05
US11042TAA16	3,800 BRITISH AIRWAYS 2018-1 CLASS AA 20.09.31	0,00	-3.414,95	93.842,60	110,20	92.003,73 0,07
US11043HAA68	4,125 BRITISH AIRWAYS 2018-1 CLASS A PASS 20.09.31	0,00	-6.692,94	187.863,48	107,10	179.007,65 0,13
US11043XAA19	3,300 BRITISH AIRWAYS 2019-1 CLASS AA 15.12.32	0,00	-18,93	199.981,07	107,16	190.651,88 0,14
US111021AE12	9,625 BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC 15.12.30	0,00	0,00	200.000,00	154,51	274.925,27 0,20
US11120VAA17	3,850 BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP 01.02.25	0,00	0,00	250.000,00	107,04	238.074,96 0,17
US11134LAH24	3,875 BROADCOM CORP / BROADCOM CAYMAN 15.01.27	0,00	0,00	400.000,00	99,97	355.761,56 0,26
US11135FAE16	4,250 BROADCOM INC 15.04.26	200.000,00	-100.000,00	100.000,00	101,79	90.559,16 0,07

US11271LAB80	4,700 BROOKFIELD FINANCE INC 20.09.47	0,00	-400.000,00	300.000,00	111,05	296.396,80	0,22
US126117AV22	3,900 CNA FINANCIAL CORP 01.05.29	0,00	0,00	200.000,00	105,51	187.741,10	0,14
US12621EAL74	5,250 CNO FINANCIAL GROUP INC 30.05.29	0,00	0,00	200.000,00	115,49	205.505,34	0,15
US126307BA42	5,750 CSC HOLDINGS LLC 15.01.30	0,00	0,00	300.000,00	101,50	270.904,80	0,20
US12634GAA13	2,625 CNOOC FINANCE 2015 AUSTRALIA PTY 05.05.20	0,00	0,00	400.000,00	100,18	356.507,12	0,26
US126650CY46	4,780 CVS HEALTH CORP 25.03.38	300.000,00	0,00	300.000,00	111,68	298.084,96	0,22
US126650DG21	3,250 CVS HEALTH CORP 15.08.29	0,00	0,00	200.000,00	102,22	181.877,22	0,13
US126650UA25	4,704 CVS PASS-THROUGH TRUST SERIES 2013 10.01.36	0,00	-6.852,30	325.757,45	111,64	323.567,86	0,24
US12673PAJ49	4,700 CA INC 15.03.27	0,00	0,00	100.000,00	109,67	97.571,17	0,07
US134429BE86	3,650 CAMPBELL SOUP CO 15.03.23	0,00	-214.000,00	86.000,00	103,70	79.339,59	0,06
US136385AL51	6,250 CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 15.03.38	100.000,00	0,00	100.000,00	95,49	84.953,29	0,06
US138616AE73	4,875 CANTOR FITZGERALD LP 01.05.24	0,00	0,00	200.000,00	105,81	188.268,68	0,14
US161175BJ23	3,750 CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING 15.02.28	0,00	0,00	500.000,00	102,71	456.908,36	0,33
US161175BL78	5,375 CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING 01.05.47	0,00	0,00	300.000,00	104,90	279.974,20	0,20
US18551PAC32	3,743 CLECO CORPORATE HOLDINGS LLC 01.05.26	0,00	0,00	700.000,00	105,77	658.737,99	0,48
US205887CC49	4,850 CONAGRA BRANDS INC 01.11.28	0,00	0,00	400.000,00	112,74	401.208,19	0,29
US21036PAN87	4,750 CONSTELLATION BRANDS INC 15.11.24	0,00	0,00	500.000,00	111,55	496.203,29	0,36
US21036PAY43	3,600 CONSTELLATION BRANDS INC 15.02.28	0,00	0,00	500.000,00	105,05	467.299,82	0,34
US22003BAK26	5,000 CORPORATE OFFICE PROPERTIES LP 01.07.25	0,00	0,00	300.000,00	112,36	299.893,24	0,22
US225401AD03	2,997 CREDIT SUISSE GROUP AG 14.12.23	0,00	0,00	700.000,00	102,47	638.130,34	0,47
US225401AF50	3,869 CREDIT SUISSE GROUP AG 12.01.29	0,00	0,00	400.000,00	104,59	372.213,52	0,27
US225401AM02	2,593 CREDIT SUISSE GROUP AG 11.09.25	0,00	0,00	400.000,00	99,06	352.526,69	0,26
US225433AH43	3,800 CREDIT SUISSE GROUP FUNDING 15.09.22	0,00	0,00	700.000,00	102,59	638.896,35	0,47
US22822VAC54	3,700 CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 15.06.26	0,00	0,00	100.000,00	106,80	95.018,24	0,07
US22822VAG68	3,200 CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 01.09.24	0,00	0,00	500.000,00	101,75	452.637,90	0,33
US22822VAH42	3,650 CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 01.09.27	0,00	0,00	200.000,00	106,24	189.047,15	0,14
US22822VAL53	4,300 CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 15.02.29	0,00	0,00	100.000,00	112,91	100.455,96	0,07
US22822VAN10	3,100 CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 15.11.29	0,00	0,00	400.000,00	99,06	352.537,37	0,26
US24703DAY76	4,000 DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 15.07.24	0,00	0,00	300.000,00	101,51	270.935,50	0,20
US24703DAZ42	4,900 DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 01.10.26	0,00	0,00	100.000,00	102,63	91.310,50	0,07
US251526BX61	4,250 DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 14.10.21	0,00	0,00	650.000,00	99,64	576.212,86	0,42
US25389JAU07	3,600 DIGITAL REALTY TRUST LP 01.07.29	0,00	0,00	200.000,00	105,80	188.263,35	0,14
US254709AM01	4,100 DISCOVERY FINANCIAL SERVICES 09.02.27	0,00	0,00	600.000,00	106,14	566.596,98	0,41
US25470DBF50	4,125 DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 15.05.29	0,00	0,00	200.000,00	106,07	188.743,77	0,14
US257559AK07	6,750 DOMTAR CORP 15.02.44	0,00	0,00	200.000,00	102,96	183.202,85	0,13
US26139PAB94	4,848 DP WORLD CRESCENT LTD 26.09.28	0,00	0,00	500.000,00	103,33	459.637,46	0,34
US26209NAK90	8,000 DRIVETIME AUTOMOTIVE GROUP INC / 01.06.21	0,00	0,00	300.000,00	94,87	253.214,41	0,18
US26884LAF67	3,900 EQT CORP 01.10.27	0,00	-100.000,00	200.000,00	58,95	104.885,23	0,08
US26884UAB52	4,500 EPR PROPERTIES 01.04.25	0,00	0,00	100.000,00	107,30	95.463,97	0,07
US26884UAE91	4,950 EPR PROPERTIES 15.04.28	0,00	0,00	200.000,00	112,03	199.346,09	0,15
US26884UAF66	3,750 EPR PROPERTIES 15.08.29	100.000,00	0,00	200.000,00	102,88	183.056,93	0,13
US26885BAA89	4,000 EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 01.08.24	0,00	0,00	300.000,00	76,68	204.651,24	0,15
US269246BQ61	3,800 E*TRADE FINANCIAL CORP 24.08.27	0,00	0,00	200.000,00	106,98	190.356,76	0,14
US278642AU75	3,000 EBAY INC 05.06.27	0,00	0,00	100.000,00	101,17	90.009,34	0,07
US29082HAA05	5,050 EMBRAER NETHERLANDS FINANCE BV 15.06.25	0,00	0,00	200.000,00	101,28	180.218,86	0,13
US292480AK65	4,400 ENABLE MIDSTREAM PARTNERS LP 15.03.27	0,00	0,00	100.000,00	76,59	68.140,57	0,05
US292480AL49	4,950 ENABLE MIDSTREAM PARTNERS LP 15.05.28	500.000,00	-50.000,00	750.000,00	77,44	516.719,30	0,38
US29250NAW56	6,250 ENBRIDGE INC 01.03.78	0,00	0,00	300.000,00	91,97	245.474,20	0,18
US29273RAP47	6,050 ENERGY TRANSFER OPERATING LP 01.06.41	0,00	0,00	500.000,00	88,63	394.266,01	0,29
US29278GAH11	4,250 ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 14.09.23	0,00	0,00	300.000,00	106,26	283.610,77	0,21
US29278GAJ76	4,625 ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 14.09.25	0,00	0,00	400.000,00	109,07	388.145,91	0,28
US29278NAG88	5,250 ENERGY TRANSFER OPERATING LP 15.04.29	0,00	0,00	100.000,00	101,89	90.649,47	0,07
US29278NAL73	4,250 ENERGY TRANSFER OPERATING LP 15.03.23	0,00	0,00	400.000,00	97,64	347.489,32	0,25
US29364GAJ22	2,950 ENTERGY CORP 01.09.26	0,00	0,00	300.000,00	102,87	274.564,06	0,20
US29379VAY92	4,450 ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 15.02.43	0,00	0,00	303.000,00	88,97	239.849,84	0,18
US294429AL98	3,250 EQUIFAX INC 01.06.26	0,00	0,00	300.000,00	106,81	285.089,41	0,21
US29717PAP27	3,500 ESSEX PORTFOLIO LP 01.04.25	0,00	0,00	400.000,00	108,30	385.393,24	0,28
US30212PAP09	3,800 EXPEDIA GROUP INC 15.02.28	600.000,00	0,00	600.000,00	96,09	512.911,92	0,37
US303901BB79	4,850 FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD 17.04.28	0,00	0,00	100.000,00	107,59	95.723,31	0,07
US30575FAA66	7,875 FAIRSTONE FINANCIAL INC 15.07.24	0,00	0,00	100.000,00	103,65	92.215,75	0,07
US31428XBS45	4,950 FEDEX CORP 17.10.48	200.000,00	0,00	200.000,00	98,31	174.927,05	0,13
US31428XBV73	3,100 FEDEX CORP 05.08.29	100.000,00	0,00	100.000,00	98,04	87.224,20	0,06
US31620RAF29	5,500 FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC 01.09.22	0,00	0,00	800.000,00	108,46	771.957,30	0,56
US31847RAE27	4,300 FIRST AMERICAN FINANCIAL CORP 01.02.23	0,00	0,00	150.000,00	105,94	141.379,00	0,10
US31847RAF91	4,600 FIRST AMERICAN FINANCIAL CORP 15.11.24	0,00	0,00	375.000,00	110,61	369.011,34	0,27
US337738AR95	4,200 FISERV INC 01.10.28	0,00	0,00	100.000,00	104,58	93.040,48	0,07
US33938EAU10	4,750 FLEX LTD 15.06.25	0,00	0,00	400.000,00	107,92	384.060,50	0,28
US345397VR12	5,750 FORD MOTOR CREDIT CO LLC 01.02.21	0,00	0,00	600.000,00	100,92	538.742,88	0,39
US345397YY36	2,710 FORD MOTOR CREDIT CO LLC 05.04.21	0,00	0,00	400.000,00	98,55	350.718,86	0,26
US345397ZM88	5,596 FORD MOTOR CREDIT CO LLC 07.01.22	0,00	0,00	500.000,00	101,49	451.472,42	0,33
US34960PAB76	6,500 FORTRESS TRANSPORTATION & 01.10.25	0,00	0,00	200.000,00	99,72	177.433,27	0,13
US35137LAE56	5,576 FOX CORP 25.01.49	0,00	0,00	400.000,00	119,10	423.848,75	0,31
US35640YAA55	8,125 FREEDOM MORTGAGE CORP 15.11.24	0,00	0,00	100.000,00	92,98	82.723,31	0,06
US35640YAB39	8,250 FREEDOM MORTGAGE CORP 15.04.25	0,00	0,00	100.000,00	92,79	82.550,71	0,06
US35640YAD94	10,75 FREEDOM MORTGAGE CORP 01.04.24	0,00	0,00	100.000,00	104,76	93.205,07	0,07
US361448AY97	3,250 GATX CORP 15.09.26	0,00	0,00	100.000,00	106,69	94.918,15	0,07
US36164QNA21	4,418 GE CAPITAL INTERNATIONAL FUNDING CO 15.11.35	0,00	0,00	1.594.000,00	101,55	1.440.066,96	1,05
US361841AJ81	5,250 GLP CAPITAL LP / GLP FINANCING II 01.06.25	0,00	0,00	100.000,00	111,31	99.027,14	0,07
US361841AK54	5,750 GLP CAPITAL LP / GLP FINANCING II 01.06.28	0,00	0,00	100.000,00	112,96	100.496,00	0,07
US361841AP42	4,000 GLP CAPITAL LP / GLP FINANCING II 15.01.30	200.000,00	0,00	200.000,00	102,93	183.151,24	0,13
US36186CBY84	8,000 ALLY FINANCIAL INC 01.11.31	0,00	0,00	200.000,00	129,25	229.975,08	0,17
US36962GXZ26	6,750 GENERAL ELECTRIC CO 15.03.32	0,00	0,00	115.000,00	120,05	122.822,86	0,09
US37045XCR52	5,100 GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 17.01.24	0,00	0,00	100.000,00	103,66	92.222,42	0,07
US38148LAE65	3,750 GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 22.05.25	0,00	0,00	500.000,00	104,97	466.935,05	0,34
US39138QAA31	4,047 GREAT-WEST LIFECO FINANCE 2018 LP 17.05.28	0,00	0,00	300.000,00	113,88	303.940,83	0,22
US39530VAA61	5,550 GREENKO SOLAR MAURITIUS LTD 29.01.25	0,00	0,00	200.000,00	93,27	165.967,08	0,12

US40139LAF04	2,900 GUARDIAN LIFE GLOBAL FUNDING 06.05.24	0,00	0,00	200.000,00	104,49	185.932,38	0,14
US404119BT57	5,250 HCA INC 15.06.26	0,00	0,00	300.000,00	108,08	288.479,09	0,21
US40427LAB09	10,18 HSBC CAPITAL FUNDING DOLLAR 1 LP 29.12.49	0,00	0,00	300.000,00	162,38	433.397,24	0,32
US404280AU33	4,250 HSBC HOLDINGS PLC 18.08.25	0,00	0,00	600.000,00	99,19	529.489,32	0,39
US404280BW89	2,164 HSBC HOLDINGS PLC 12.09.26	0,00	0,00	700.000,00	98,89	615.859,88	0,45
US406216AY74	7,450 HALLIBURTON CO 15.09.39	0,00	0,00	200.000,00	110,40	196.447,51	0,14
US413875AR63	3,832 LHARRIS TECHNOLOGIES INC 27.04.25	0,00	0,00	100.000,00	107,72	95.840,30	0,07
US431282AR39	4,200 HIGHWOODS REALTY LP 15.04.29	0,00	0,00	100.000,00	111,67	99.350,09	0,07
US437076BD31	4,875 HOME DEPOT INC/THE 15.02.44	300.000,00	0,00	300.000,00	127,81	341.127,22	0,25
US44106MAY84	4,375 SERVICE PROPERTIES TRUST 15.02.30	0,00	0,00	100.000,00	96,50	85.850,09	0,06
US44107TAV89	4,000 HOST HOTELS & RESORTS LP 15.06.25	0,00	0,00	100.000,00	107,23	95.399,47	0,07
US44107TAX46	3,875 HOST HOTELS & RESORTS LP 01.04.24	0,00	0,00	100.000,00	105,74	94.071,17	0,07
US44701QBE17	4,500 HUNTSMAN INTERNATIONAL LLC 01.05.29	0,00	0,00	200.000,00	105,72	188.111,21	0,14
US44962LAG23	4,125 IHS MARKIT LTD 01.08.23	0,00	0,00	100.000,00	104,04	92.558,72	0,07
US44962LAJ61	4,250 IHS MARKIT LTD 01.05.29	0,00	0,00	300.000,00	112,66	300.705,96	0,22
US45262BAB99	3,500 IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC 26.07.26	200.000,00	0,00	200.000,00	97,73	173.887,90	0,13
US45262BAC72	3,875 IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC 26.07.29	0,00	0,00	300.000,00	104,44	278.762,46	0,20
US459745GK57	8,625 INTERNATIONAL LEASE FINANCE CORP 15.01.22	0,00	0,00	150.000,00	108,06	144.203,51	0,11
US46647PAH91	3,220 JPMORGAN CHASE & CO 01.03.25	0,00	0,00	500.000,00	103,31	459.552,94	0,34
US46647PAR73	4,005 JPMORGAN CHASE & CO 23.04.29	0,00	0,00	700.000,00	108,21	673.905,69	0,49
US46647PAW68	2,696 JPMORGAN CHASE & CO 23.07.24	0,00	0,00	900.000,00	95,70	766.269,12	0,56
US46647PBD78	3,702 JPMORGAN CHASE & CO 06.05.30	400.000,00	0,00	600.000,00	109,53	584.703,73	0,43
US46647PBF27	2,301 JPMORGAN CHASE & CO 15.10.25	0,00	0,00	700.000,00	99,80	621.508,45	0,45
US47232MAD48	7,250 JEFFERIES FINANCE LLC / JFIN CO 15.08.24	0,00	0,00	400.000,00	102,00	362.976,86	0,26
US47233GAA22	6,875 LOANCORE CAPITAL MARKETS LLC / JLC 01.06.20	0,00	0,00	200.000,00	100,11	178.131,67	0,13
US485170BA12	3,125 KANSAS CITY SOUTHERN 01.06.26	0,00	0,00	200.000,00	105,51	187.744,66	0,14
US49446RAT68	4,450 KIMCO REALTY CORP 01.09.47	0,00	0,00	100.000,00	119,24	106.088,08	0,08
US494550AQ90	7,300 KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 15.08.33	0,00	0,00	200.000,00	117,32	208.759,79	0,15
US49456BAH42	5,550 KINDER MORGAN INC/DE 01.06.45	200.000,00	0,00	200.000,00	97,72	173.871,89	0,13
US50077LAM81	5,200 KRAFT HEINZ FOODS CO 15.07.45	0,00	-100.000,00	900.000,00	101,76	814.828,29	0,59
US50077LAR78	3,375 KRAFT HEINZ FOODS CO 15.06.21	0,00	0,00	200.000,00	100,64	179.075,62	0,13
US52107QAG01	3,750 LAZARD GROUP LLC 13.02.25	0,00	0,00	400.000,00	109,61	390.065,84	0,28
US524901AR65	5,625 LEGG MASON INC 15.01.44	0,00	0,00	400.000,00	138,24	491.953,74	0,36
US53944YAF07	4,450 LLOYDS BANKING GROUP PLC 08.05.25	0,00	0,00	1.000.000,00	107,49	956.356,76	0,70
US55303XAF24	4,500 MGM GROWTH PROPERTIES OPERATING 15.01.28	0,00	0,00	100.000,00	92,40	82.209,52	0,06
US55336VAP58	4,900 MPLX LP 15.04.58	0,00	0,00	100.000,00	77,39	68.848,31	0,05
US55336VAT70	5,500 MPLX LP 15.02.49	200.000,00	0,00	200.000,00	83,73	148.982,21	0,11
US55448QAQ91	4,500 MACK-CALI REALTY LP 18.04.22	100.000,00	0,00	100.000,00	102,74	91.407,92	0,07
US571903AX17	4,500 MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 01.10.34	0,00	0,00	300.000,00	95,49	254.877,22	0,19
US58013MFK53	3,625 MCDONALD'S CORP 01.09.49	0,00	0,00	300.000,00	100,97	269.490,21	0,20
US58547DAC39	5,625 MELCO RESORTS FINANCE LTD 17.07.27	0,00	0,00	300.000,00	99,88	266.583,63	0,19
US59156RBN70	4,050 METLIFE INC 01.03.45	300.000,00	0,00	300.000,00	106,28	283.669,48	0,21
US594918BE30	4,000 MICROSOFT CORP 12.02.55	200.000,00	0,00	200.000,00	122,70	218.325,62	0,16
US595112BN22	5,327 MICRON TECHNOLOGY INC 06.02.29	100.000,00	0,00	100.000,00	109,82	97.706,41	0,07
US595112BQ52	4,663 MICRON TECHNOLOGY INC 15.02.30	0,00	0,00	200.000,00	104,51	185.953,74	0,14
US59523UAL17	3,750 MID-AMERICA APARTMENTS LP 15.06.24	0,00	0,00	300.000,00	107,13	285.927,49	0,21
US59523UAN72	3,600 MID-AMERICA APARTMENTS LP 01.06.27	0,00	0,00	100.000,00	109,06	97.029,36	0,07
US606822AZ74	2,654 MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 26.07.23	0,00	0,00	100.000,00	88,66	78.881,67	0,06
US606822BJ24	2,801 MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 18.07.24	0,00	0,00	600.000,00	101,97	544.329,18	0,40
US60687YAV11	2,721 MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 16.07.23	0,00	0,00	400.000,00	101,83	362.396,80	0,26
US620076BL24	4,600 MOTOROLA SOLUTIONS INC 23.02.28	0,00	0,00	400.000,00	107,79	383.597,86	0,28
US62854AAN46	3,950 MYLAN NV 15.06.26	0,00	0,00	400.000,00	103,39	367.939,50	0,27
US63861VAC19	4,363 NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 01.08.24	0,00	0,00	300.000,00	105,10	280.516,01	0,20
US63861VAD91	3,622 NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 26.04.23	0,00	0,00	200.000,00	102,62	182.595,20	0,13
US63946BAG59	5,950 NBCUNIVERSAL MEDIA LLC 01.04.41	200.000,00	0,00	850.000,00	136,44	1.031.800,93	0,75
US64952GAQ10	4,450 NEW YORK LIFE INSURANCE CO 15.05.69	0,00	0,00	200.000,00	122,63	218.209,07	0,16
US651290AR99	5,375 NEWFIELD EXPLORATION CO 01.01.26	0,00	0,00	100.000,00	69,21	61.571,62	0,04
US65339KBD19	3,300 NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC 15.08.22	800.000,00	0,00	800.000,00	103,90	739.505,32	0,54
US65339KBK51	5,650 NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC 01.05.79	0,00	0,00	200.000,00	103,37	183.935,94	0,13
US654579AD34	5,100 NIPPON LIFE INSURANCE CO 16.10.44	0,00	0,00	200.000,00	109,92	195.586,30	0,14
US667294BB72	6,264 NORTHWEST AIRLINES 2002-1 CLASS G-2 20.11.21	0,00	-20.273,17	15.366,11	102,89	14.066,41	0,01
US66775VAB18	4,000 NORTHWEST PIPELINE LLC 01.04.27	0,00	0,00	300.000,00	101,66	271.339,86	0,20
US67576GAC15	6,720 ODEBRECHT OFFSHORE DRILLING FINANCE 01.12.22	0,02	-5.408,09	44.992,17	97,51	39.032,30	0,03
US67576GAD97	7,720 ODEBRECHT OFFSHORE DRILLING FINANCE 01.12.26	7.229,00	0,00	222.043,00	22,24	43.931,46	0,03
US68233JBH68	3,700 ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO LLC 15.11.28	600.000,00	0,00	600.000,00	112,87	602.527,58	0,44
US682680AS26	4,000 ONEOK INC 13.07.27	0,00	0,00	300.000,00	103,17	275.354,09	0,20
US682680AU71	4,550 ONEOK INC 15.07.28	400.000,00	0,00	600.000,00	103,05	550.083,62	0,40
US682680AW38	4,350 ONEOK INC 15.03.29	0,00	0,00	300.000,00	92,98	248.167,26	0,18
US68268NAP87	4,900 ONEOK PARTNERS LP 15.03.25	0,00	0,00	200.000,00	106,28	189.109,43	0,14
US68389XAM74	5,375 ORACLE CORP 15.07.40	300.000,00	0,00	300.000,00	128,50	342.980,87	0,25
US68389XBQ79	4,000 ORACLE CORP 15.11.47	0,00	0,00	300.000,00	114,37	305.260,68	0,22
US690742AF87	3,400 OWENS CORNING 15.08.26	0,00	0,00	300.000,00	105,84	282.501,78	0,21
US70014LAA89	5,250 PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD 15.08.22	0,00	0,00	800.000,00	101,24	720.572,95	0,53
US70014LAB62	5,500 PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD 15.02.24	0,00	0,00	100.000,00	105,11	93.509,79	0,07
US709599AZ77	3,950 PENSKE TRUCK LEASING CO LP / PTL 10.03.25	0,00	0,00	300.000,00	108,76	290.286,03	0,21
US71568QAC15	4,125 PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT 15.05.27	0,00	0,00	200.000,00	102,59	182.547,15	0,13
US71654QBW15	4,500 PETROLEOS MEXICANOS 23.01.26	0,00	0,00	100.000,00	82,78	73.645,91	0,05
US71654QCG55	6,500 PETROLEOS MEXICANOS 13.03.27	0,00	0,00	800.000,00	84,62	602.281,13	0,44
US71951QAA04	4,300 PHYSICIANS REALTY LP 15.03.27	0,00	0,00	100.000,00	111,70	99.375,89	0,07
US723787AB37	7,200 PIONEER NATURAL RESOURCES CO 15.01.28	0,00	0,00	100.000,00	132,22	117.634,34	0,09
US72650RBA95	5,150 PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / 01.06.42	0,00	-200.000,00	200.000,00	76,68	136.444,84	0,10
US74251VAR33	3,700 PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC 15.05.29	0,00	0,00	100.000,00	106,69	94.915,48	0,07
US744320BF81	5,700 PRUDENTIAL FINANCIAL INC 15.09.48	300.000,00	0,00	300.000,00	103,62	276.555,16	0,20
US747262AH67	5,125 QVC INC 02.07.22	0,00	0,00	300.000,00	95,47	254.825,18	0,19
US750236AW16	4,875 RADIAN GROUP INC 15.03.27	0,00	0,00	400.000,00	104,04	370.243,77	0,27
US75625AAB08	7,750 RECKSON OPERATING PARTNERSHIP LP 15.03.20	0,00	0,00	100.000,00	100,00	88.967,97	0,06



US75625AAD63	4,500 SL GREEN REALTY CORP 01.12.22	0,00	0,00	500.000,00	107,07	476.285,59	0,35
US759351AM18	3,950 REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC 15.09.26	0,00	0,00	400.000,00	108,57	386.371,89	0,28
US75968NAD30	3,600 RENAISSANCERE HOLDINGS LTD 15.04.29	0,00	0,00	100.000,00	112,40	100.000,00	0,07
US76113AAG67	2,007 RASC SERIES 2006-KS1 TRUST 25.02.36	0,00	-154.433,69	314.609,28	99,80	279.343,70	0,20
US77578JAB44	3,625 ROLLS-ROYCE PLC 14.10.25	200.000,00	0,00	200.000,00	105,87	188.381,67	0,14
US780097BE04	3,498 ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC 15.05.23	0,00	0,00	700.000,00	101,88	634.512,01	0,46
US780097BG51	4,892 ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC 18.05.29	0,00	0,00	600.000,00	109,26	583.214,41	0,43
US78448TAA07	2,650 SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC 15.07.21	0,00	0,00	300.000,00	101,52	270.959,52	0,20
US78448TAE29	3,550 SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC 15.04.24	0,00	0,00	200.000,00	105,20	187.186,83	0,14
US785592AJ58	5,750 SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 15.05.24	0,00	0,00	1.175.000,00	104,69	1.094.448,73	0,80
US785592AV86	5,875 SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 30.06.26	0,00	0,00	100.000,00	97,84	87.048,49	0,06
US80007RAB15	4,600 SANDS CHINA LTD 08.08.23	0,00	0,00	1.500.000,00	107,60	1.435.956,41	1,05
US80281LAA35	4,750 SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 15.09.25	200.000,00	0,00	200.000,00	106,34	189.209,07	0,14
US80282KAE64	4,500 SANTANDER HOLDINGS USA INC 17.07.25	0,00	0,00	1.000.000,00	105,18	935.747,33	0,68
US816851BG34	3,400 SEMPRA ENERGY 01.02.28	0,00	0,00	300.000,00	102,95	274.765,57	0,20
US822582AY86	4,550 SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 12.08.43	200.000,00	0,00	200.000,00	111,16	197.791,81	0,14
US82481LAD10	3,200 SHIRE ACQUISITIONS INVESTMENTS 23.09.26	0,00	0,00	100.000,00	102,09	90.825,62	0,07
US825547AA08	5,950 SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD 24.10.22	0,00	0,00	400.000,00	93,36	332.243,77	0,24
US82939GAB41	4,125 SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT 12.09.25	0,00	0,00	400.000,00	110,19	392.135,23	0,29
US83368RAK86	4,000 SOCIETE GENERALE SA 12.01.27	0,00	0,00	700.000,00	104,14	648.571,17	0,47
US842400FZ13	4,650 SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 01.10.43	100.000,00	0,00	100.000,00	115,55	102.801,16	0,08
US842400GG23	4,000 SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 01.04.47	400.000,00	0,00	600.000,00	99,40	530.626,33	0,39
US842400GJ61	3,650 SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 01.03.28	0,00	0,00	300.000,00	107,99	288.230,87	0,21
US842400GN73	3,700 SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 01.08.25	0,00	0,00	200.000,00	107,79	191.792,70	0,14
US84474YAB20	6,650 SOUTHWEST AIRLINES CO 2007-1 PASS 01.08.22	0,00	-12.030,39	68.160,21	105,88	64.207,04	0,05
US84610WAB19	3,500 LIFESTORAGE LP/CA 01.07.26	0,00	0,00	300.000,00	105,48	281.536,92	0,21
US84858XAA28	3,650 SPIRIT AIRLINES PASS THROUGH TRUST 15.02.30	184.870,56	-5.684,62	179.185,94	105,25	167.781,97	0,12
US85205TAK60	4,600 SPIRIT AEROSYSTEMS INC 15.06.28	100.000,00	0,00	300.000,00	83,63	223.222,41	0,16
US85207UAE55	7,250 SPRINT CORP 15.09.21	0,00	0,00	100.000,00	102,90	91.550,71	0,07
US85207UAH86	7,125 SPRINT CORP 15.06.24	100.000,00	0,00	100.000,00	108,24	96.296,71	0,07
US85208NAD21	4,738 SPRINT SPECTRUM CO LLC / SPRINT 20.03.25	0,00	0,00	300.000,00	104,13	277.937,72	0,20
US853254BN98	3,785 STANDARD CHARTERED PLC 21.05.25	0,00	0,00	300.000,00	103,93	277.391,90	0,20
US853496AB34	5,500 STANDARD INDUSTRIES INC/NJ 15.02.23	0,00	-112.000,00	88.000,00	99,79	78.125,44	0,06
US853496AD99	4,750 STANDARD INDUSTRIES INC/NJ 15.01.28	0,00	0,00	100.000,00	98,23	87.395,46	0,06
US863667AN16	3,500 STRYKER CORP 15.03.26	0,00	0,00	300.000,00	107,63	287.279,36	0,21
US86562MBA71	2,679 SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 19.07.23	0,00	0,00	100.000,00	99,53	88.548,04	0,06
US87124VAF67	3,625 SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD 28.04.26	0,00	0,00	400.000,00	106,16	377.781,14	0,28
US87164KAC80	5,182 SYNGENTA FINANCE NV 24.04.28	200.000,00	0,00	200.000,00	116,95	208.093,42	0,15
US87164KAG94	4,892 SYNGENTA FINANCE NV 24.04.25	0,00	0,00	200.000,00	108,18	192.490,21	0,14
US87164KAH77	4,441 SYNGENTA FINANCE NV 24.04.23	200.000,00	0,00	200.000,00	103,51	184.183,27	0,13
US87165BAC72	3,750 SYNCHRONY FINANCIAL 15.08.21	0,00	0,00	300.000,00	101,25	270.240,21	0,20
US87165BAM54	3,950 SYNCHRONY FINANCIAL 01.12.27	0,00	0,00	500.000,00	96,24	428.109,43	0,31
US87264AAV70	4,750 T-MOBILE USA INC 01.02.28	0,00	0,00	200.000,00	99,07	176.283,81	0,13
US878091BE69	4,375 TEACHERS INSURANCE & ANNUITY 15.09.54	0,00	0,00	1.000.000,00	106,50	947.540,04	0,69
US87938WAV54	4,665 TELEFONICA EMISIONES SA 06.03.38	700.000,00	0,00	1.000.000,00	107,78	958.932,38	0,70
US88032WAN65	3,975 TENCENT HOLDINGS LTD 11.04.29	0,00	0,00	500.000,00	109,72	488.093,86	0,36
US88165FAG72	2,950 TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE CO BV 18.12.22	0,00	0,00	100.000,00	88,06	78.346,09	0,06
US88166JAA16	3,650 TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE IV BV 10.11.21	0,00	0,00	100.000,00	94,32	83.911,92	0,06
US893574AH62	7,850 TRANSCONTINENTAL GAS PIPE LINE CO 01.02.26	0,00	0,00	300.000,00	117,19	312.792,70	0,23
US89380AAA08	5,875 TRANSOCEAN GUARDIAN LTD 15.01.24	11.002,09	-22.002,09	167.000,00	82,86	123.110,49	0,09
US898339AA49	4,869 TRUST FIBRA UNO 15.01.30	0,00	0,00	200.000,00	103,76	184.619,22	0,13
US902494BH59	5,100 TYSON FOODS INC 28.09.48	0,00	0,00	300.000,00	121,54	324.383,01	0,24
US90265EAJ91	3,750 UDR INC 01.07.24	0,00	0,00	200.000,00	107,36	191.033,81	0,14
US90265EAR18	3,000 UDR INC 15.08.31	0,00	0,00	100.000,00	98,51	87.638,79	0,06
US90345WAA27	5,900 US AIRWAYS 2012-1 CLASS A PASS 01.10.24	0,00	-10.369,79	175.506,33	113,84	177.756,37	0,13
US90351DAB38	4,125 UBS GROUP AG 24.09.25	0,00	0,00	200.000,00	107,21	190.772,24	0,14
US90352JAC71	4,253 UBS GROUP AG 23.03.28	0,00	0,00	500.000,00	109,02	484.979,98	0,35
US90352JAD54	2,642 UBS GROUP AG 15.08.23	0,00	0,00	200.000,00	93,99	167.245,55	0,12
US90352JAE38	2,859 UBS GROUP AG 15.08.23	0,00	0,00	300.000,00	101,78	271.644,13	0,20
US907818FE31	3,950 UNION PACIFIC CORP 15.08.59	0,00	0,00	100.000,00	112,18	99.803,38	0,07
US90931CAA62	4,150 UNITED AIRLINES 2019-1 CLASS AA 25.08.31	100.000,00	-11.116,91	88.883,09	110,35	87.264,77	0,06
US90931LAA61	3,100 UNITED AIRLINES 2016-1 CLASS AA 07.07.28	0,00	-7.914,85	260.425,23	104,02	241.008,02	0,18
US90932JAA07	2,700 UNITED AIRLINES 2019-2 CLASS AA 01.05.32	200.000,00	0,00	200.000,00	95,93	170.693,06	0,12
US90932PAA66	4,000 UNITED AIRLINES 2014-1 CLASS A PASS 11.04.26	0,00	-5.451,27	150.198,83	106,94	142.900,02	0,10
US91087BAD29	4,600 MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL 10.02.48	0,00	0,00	200.000,00	98,07	174.499,11	0,13
US9128287D64	0,250 UNITED STATES TREASURY INFLATION 15.07.29	1.511.280,00	-1.530,00	1.509.750,00	102,56	1.377.515,13	1,01
US914906AS13	5,125 UNIVISION COMMUNICATIONS INC 15.02.25	100.000,00	0,00	100.000,00	87,92	78.222,42	0,06
US91911TAP84	6,250 VALE OVERSEAS LTD 10.08.26	0,00	0,00	400.000,00	109,92	391.160,14	0,29
US91913YAW03	4,000 VALERO ENERGY CORP 01.04.29	0,00	0,00	200.000,00	95,85	170.545,37	0,12
US92343VCK89	4,862 VERIZON COMMUNICATIONS INC 21.08.46	0,00	0,00	100.000,00	124,12	110.425,27	0,08
US92343VDC54	4,125 VERIZON COMMUNICATIONS INC 15.08.46	0,00	0,00	500.000,00	112,63	501.036,48	0,37
US92343VDR24	4,812 VERIZON COMMUNICATIONS INC 15.03.39	300.000,00	0,00	300.000,00	122,44	326.795,82	0,24
US92857WBS89	4,875 VODAFONE GROUP PLC 19.06.49	200.000,00	0,00	200.000,00	105,54	187.793,59	0,14
US928668AQ54	2,653 VOLKSWAGEN GROUP OF AMERICA FINANCE 12.11.21	0,00	0,00	400.000,00	100,94	359.222,42	0,26
US92936UAC36	4,000 WP CAREY INC 01.02.25	0,00	0,00	200.000,00	108,12	192.379,89	0,14
US92936UAE91	4,250 WP CAREY INC 01.10.26	0,00	0,00	200.000,00	109,91	195.577,40	0,14
US92940PAB04	4,650 WRKCO INC 15.03.26	0,00	0,00	400.000,00	110,93	394.781,14	0,29
US931142EB57	3,950 WALMART INC 28.06.38	400.000,00	0,00	400.000,00	117,38	417.727,76	0,30
US93369KAA34	8,125 NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC 15.07.23	0,00	0,00	100.000,00	99,88	88.859,43	0,06
US939648AE19	6,450 WASHINGTON PRIME GROUP LP 15.08.24	0,00	0,00	300.000,00	70,49	188.152,58	0,14
US949746RW34	3,000 WELLS FARGO & CO 22.04.26	0,00	0,00	100.000,00	100,49	89.401,69	0,07
US949746SJ14	3,007 WELLS FARGO & CO 31.10.23	0,00	0,00	300.000,00	93,25	248.881,23	0,18
US949746SL69	2,911 WELLS FARGO & CO 24.01.23	0,00	0,00	500.000,00	98,04	436.114,32	0,32
US949746FP04	5,375 WELLS FARGO & CO 02.11.43	0,00	0,00	400.000,00	122,61	436.330,96	0,32
US95000U2B83	2,625 WELLS FARGO & CO 22.07.22	0,00	0,00	500.000,00	100,94	449.012,46	0,33

US95000U2F97	3,196 WELLS FARGO & CO 17.06.27	500.000,00	0,00	500.000,00	102,40	455.516,01	0,33
US958102AM75	4,750 WESTERN DIGITAL CORP 15.02.26	0,00	0,00	100.000,00	97,49	86.734,88	0,06
	4,400 WESTINGHOUSE AIR BRAKE TECHNOLOGIES 15.03.24	0,00	0,00	200.000,00	109,38	194.620,99	0,14
US960386AN02	4,000 WRKCO INC 15.03.28	0,00	0,00	300.000,00	114,03	304.350,53	0,22
US962166AT16	8,500 WEYERHAEUSER CO 15.01.25	0,00	0,00	200.000,00	131,12	233.309,61	0,17
US962166BR41	7,375 WEYERHAEUSER CO 15.03.32	0,00	0,00	400.000,00	129,88	462.197,51	0,34
US962166BT07	6,875 WEYERHAEUSER CO 15.12.33	0,00	0,00	100.000,00	142,11	126.427,94	0,09
US962166BX19	4,000 WEYERHAEUSER CO 15.11.29	0,00	0,00	100.000,00	103,28	91.890,12	0,07
US980236AL79	4,600 WOODSIDE FINANCE LTD 10.05.21	0,00	0,00	100.000,00	103,10	91.725,09	0,07
US980236AQ66	4,500 WOODSIDE FINANCE LTD 04.03.29	0,00	0,00	300.000,00	109,24	291.552,49	0,21
US98212BAE39	5,250 WPX ENERGY INC 15.09.24	0,00	0,00	100.000,00	70,05	62.321,62	0,05
US983130AX35	5,250 WYNN LAS VEGAS LLC / WYNN LAS VEGAS 15.05.27	300.000,00	0,00	300.000,00	79,89	213.232,21	0,16
US98313RAD89	5,500 WYNN MACAU LTD 01.10.27	0,00	0,00	400.000,00	87,77	312.330,96	0,23
US984851AD75	3,800 YARA INTERNATIONAL ASA 06.06.26	0,00	0,00	200.000,00	103,57	184.285,59	0,13
US98956PAF99	3,550 ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC 01.04.25	0,00	0,00	300.000,00	103,49	276.214,86	0,20
US98978VAL71	3,000 ZOETIS INC 12.09.27	0,00	0,00	100.000,00	104,96	93.377,22	0,07
USG42045AB32	4,750 GRUPO AVAL LTD 26.09.22	0,00	0,00	200.000,00	99,01	176.169,04	0,13
USG5975LAA47	4,875 MELCO RESORTS FINANCE LTD 06.06.25	0,00	0,00	300.000,00	100,01	266.937,28	0,19
USG82296AD99	3,550 SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC 15.04.24	0,00	0,00	200.000,00	105,20	187.186,83	0,14
USP16259AK29	4,375 BBVA BANCOMER SA/TEXAS 10.04.24	0,00	0,00	200.000,00	104,69	186.283,81	0,14
USP3772WAJ10	4,875 BANCO DO BRASIL SA/CAYMAN 19.04.23	0,00	0,00	200.000,00	100,86	179.459,07	0,13
XS1064799841	4,750 MAF GLOBAL SECURITIES LTD 07.05.24	0,00	0,00	400.000,00	105,63	375.918,15	0,27
XS1627599142	6,250 CHINA EVERGRANDE GROUP 28.06.21	0,00	0,00	300.000,00	93,55	249.680,60	0,18
XS1653877081	2,594 BANCO SANTANDER CHILE 25.07.20	0,00	0,00	200.000,00	99,83	177.639,68	0,13
XS1794216660	4,750 PACIFIC NATIONAL FINANCE PTY LTD 22.03.28	0,00	0,00	500.000,00	108,91	484.490,65	0,35
XS1936202644	8,375 SUNAC CHINA HOLDINGS LTD 15.01.21	0,00	0,00	200.000,00	100,07	178.059,61	0,13
XS1938443329	4,000 BOC AVIATION LTD 25.01.24	0,00	0,00	600.000,00	107,83	575.620,99	0,42
XS1958532829	4,200 VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 07.06.24	0,00	0,00	200.000,00	107,54	191.356,76	0,14
	Summe USD					105.552.674,72	77,06
	Devisenmittelkurs: 1,124000						
	Zerobonds						
	Währung: USD						
US67576JAB70	0,00 ODEBRECHT OIL & GAS FINANCE LTD 03.01.67	0,00	0,00	30.712,00	0,91	248,78	0,00
	Summe USD					248,78	0,00
	Devisenmittelkurs: 1,124000						
	nicht notierte Wertpapiere						
	Anleihen						
	Währung: USD						
US76110WX275	2,677 RASC SERIES 2005-KS5 TRUST 25.06.35	0,00	0,00	600.000,00	99,17	529.361,34	0,39
US87299ATW44	4,750 TMUS DUMMY CONSENT ISIN	0,00	0,00	200.000,00	0,00	0,00	0,00
	Summe USD					529.361,34	0,39
	Devisenmittelkurs: 1,124000						
	Strips						
	Währung: USD						
US912803DV21	0,000 UNITED STATES TREASURY STRIP 15.02.42	0,00	-2.400.000,00	2.700.000,00	69,89	1.678.965,71	1,23
US912803FG36	0,000 UNITED STATES TREASURY STRIP 15.02.49	0,00	-2.300.000,00	7.700.000,00	63,47	4.348.290,30	3,17
US912803FJ74	0,000 UNITED STATES TREASURY STRIP 15.05.49	0,00	0,00	1.500.000,00	63,44	846.589,91	0,62
	Summe USD					6.873.845,92	5,02
	Devisenmittelkurs: 1,124000						
	Neuemissionen						
	Anleihen						
	Währung: USD						
US01400EAC75	3,800 ALCON FINANCE CORP 23.09.49	200.000,00	0,00	200.000,00	103,89	184.858,54	0,13
US01748TAB70	3,500 ALLEGION PLC 01.10.29	500.000,00	0,00	500.000,00	107,47	478.080,51	0,35
US05947KAZ30	3,200 BANCO BRADESCO SA/CAYMAN ISLANDS 27.01.25	300.000,00	0,00	300.000,00	96,56	257.719,75	0,19
US05968LAM46	3,000 BANCOLOMBIA SA 29.01.25	200.000,00	0,00	200.000,00	89,31	158.915,48	0,12
US05970FAC59	2,700 BANCO SANTANDER CHILE 10.01.25	200.000,00	0,00	200.000,00	94,95	168.947,51	0,12
US060505FQ25	4,300 BANK OF AMERICA CORP 28.07.68	300.000,00	0,00	300.000,00	86,13	229.884,34	0,17
US110122BU11	5,000 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 15.08.45	200.000,00	0,00	200.000,00	132,42	235.629,89	0,17
US12543DBF69	6,625 CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 15.02.25	100.000,00	0,00	100.000,00	97,04	86.332,74	0,06
US133434AD26	3,701 CAMERON LNG LLC 15.01.39	200.000,00	0,00	200.000,00	94,56	168.247,33	0,12
US142339AJ92	2,750 CARLISLE COS INC 01.03.30	400.000,00	0,00	400.000,00	96,54	343.555,16	0,25
US14314DAA19	3,500 CARLYLE FINANCE SUBSIDIARY LLC 19.09.29	0,00	0,00	100.000,00	108,17	96.237,54	0,07
US14448CAF14	2,242 CARRIER GLOBAL CORP 15.02.25	200.000,00	0,00	200.000,00	99,48	177.016,01	0,13
US15135BAS07	4,625 CENTENE CORP 15.12.29	100.000,00	0,00	100.000,00	101,93	90.683,72	0,07
US15236FAB67	4,625 CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA 04.02.30	200.000,00	0,00	200.000,00	92,11	163.902,14	0,12
US161175BT05	4,800 CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING 01.03.50	500.000,00	0,00	500.000,00	98,26	437.119,66	0,32
US172967ML25	2,666 CITIGROUP INC 29.01.31	500.000,00	0,00	500.000,00	97,18	432.304,27	0,32
US177376AF70	3,300 CITRIX SYSTEMS INC 01.03.30	200.000,00	0,00	200.000,00	96,41	171.540,04	0,13
US20030NDA63	2,650 COMCAST CORP 01.02.30	400.000,00	0,00	400.000,00	102,61	365.158,36	0,27
US209111FW83	3,700 CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK 15.11.59	400.000,00	0,00	400.000,00	105,69	376.119,22	0,27
US23283PAR55	3,450 CYRUSONE LP / CYRUSONE FINANCE CORP 15.11.29	200.000,00	0,00	200.000,00	98,15	174.645,02	0,13
US26884LAH24	6,125 EQT CORP 01.02.25	200.000,00	0,00	200.000,00	65,82	117.121,89	0,09
US29250NBB01	2,195 ENBRIDGE INC 18.02.22	400.000,00	0,00	400.000,00	95,56	340.072,95	0,25
US29278NAR44	5,000 ENERGY TRANSFER OPERATING LP 15.05.50	200.000,00	0,00	200.000,00	82,34	146.505,34	0,11
US29365TAJ34	3,550 ENTERGY TEXAS INC 30.09.49	400.000,00	0,00	400.000,00	102,72	365.560,50	0,27
US29379VBZ58	3,950 ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 31.01.60	400.000,00	0,00	400.000,00	75,62	269.104,98	0,20
US29444UBD72	2,900 EQUINIX INC 18.11.26	100.000,00	0,00	100.000,00	97,47	86.718,86	0,06
US34540XAB91	3,550 FORD MOTOR CREDIT CO LLC 07.10.22	500.000,00	0,00	500.000,00	98,00	435.956,41	0,32
US42225UAG94	3,100 HEALTHCARE TRUST OF AMERICA 15.02.30	0,00	0,00	500.000,00	102,59	456.358,99	0,33
US44107TAY29	3,375 HOST HOTELS & RESORTS LP 15.12.29	0,00	0,00	100.000,00	95,21	84.702,40	0,06

US44409MAC01	3,250 HUDSON PACIFIC PROPERTIES LP 15.01.30	200.000,00	0,00	200.000,00	102,28	182.000,00	0,13
US46556JAB52	3,250 ITAU UNIBANCO HOLDING SA/CAYMAN 24.01.25	300.000,00	0,00	300.000,00	94,35	251.835,85	0,18
US48128BAH42	4,000 JPMORGAN CHASE & CO 01.10.68	600.000,00	0,00	600.000,00	87,04	464.623,67	0,34
US517834AH06	2,900 LAS VEGAS SANDS CORP 25.06.25	200.000,00	0,00	200.000,00	92,85	165.217,08	0,12
US527298BQ51	3,875 LEVEL 3 FINANCING INC 15.11.29	300.000,00	0,00	300.000,00	100,63	268.580,07	0,20
US55303XAJ46	5,750 MGM GROWTH PROPERTIES OPERATING 01.02.27	100.000,00	0,00	100.000,00	99,69	88.689,95	0,06
US55336VBC37	5,250 MPLX LP 15.01.25	100.000,00	0,00	100.000,00	105,76	94.091,19	0,07
US55336VBE92	4,250 MPLX LP 01.12.27	100.000,00	0,00	100.000,00	87,23	77.606,76	0,06
US577081BD37	5,875 MATTEL INC 15.12.27	100.000,00	0,00	100.000,00	95,44	84.907,03	0,06
US58547DAD12	5,375 MELCO RESORTS FINANCE LTD 04.12.29	200.000,00	0,00	200.000,00	96,82	172.282,03	0,13
US62828L2B85	4,400 MUTHOOT FINANCE LTD 02.09.23	300.000,00	0,00	300.000,00	90,37	241.206,41	0,18
US638612AM35	3,900 NATIONWIDE FINANCIAL SERVICES INC 30.11.49	100.000,00	0,00	100.000,00	97,93	87.129,89	0,06
US65535HAQ20	3,103 NOMURA HOLDINGS INC 16.01.30	200.000,00	0,00	200.000,00	97,63	173.717,97	0,13
US66989HAR93	2,200 NOVARTIS CAPITAL CORP 14.08.30	500.000,00	0,00	500.000,00	102,83	457.406,58	0,33
US674599DB86	6,950 OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 01.07.24	100.000,00	0,00	100.000,00	94,57	84.134,34	0,06
US674599DC69	5,550 OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 15.03.26	300.000,00	0,00	300.000,00	83,32	222.381,67	0,16
US743674BE29	3,400 PROTECTIVE LIFE CORP 15.01.30	300.000,00	0,00	300.000,00	108,17	288.717,97	0,21
US775109BP56	3,700 ROGERS COMMUNICATIONS INC 15.11.49	500.000,00	0,00	500.000,00	101,57	451.832,74	0,33
US78410GAC87	3,875 SBA COMMUNICATIONS CORP 15.02.27	200.000,00	0,00	200.000,00	96,64	171.965,30	0,13
US78432MAA36	5,125 SBL HOLDINGS INC 13.11.26	100.000,00	0,00	100.000,00	100,10	89.056,49	0,07
US78572XAG60	3,900 SABRA HEALTH CARE LP 15.10.29	300.000,00	0,00	300.000,00	98,93	264.052,05	0,19
US80282KAZ93	3,244 SANTANDER HOLDINGS USA INC 05.10.26	300.000,00	0,00	300.000,00	98,28	262.321,17	0,19
US836205BA15	4,850 REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT 30.09.29	300.000,00	0,00	300.000,00	92,31	246.375,00	0,18
US85207UAL98	7,250 SPRINT CORP 01.02.28	100.000,00	0,00	100.000,00	99,77	88.767,35	0,06
US85801HAA23	5,000 STEARNS HOLDINGS LLC / STEARNS CO 05.11.24	2.551,00	0,00	2.551,00	67,00	1.520,61	0,00
US858119BK53	3,450 STEEL DYNAMICS INC 15.04.30	200.000,00	0,00	200.000,00	99,12	176.365,66	0,13
US858ESCAA47	0,000 STEARNS HOLDING LLC ESCROW 15.08.2049	97.000,00	0,00	97.000,00	0,00	0,00	0,00
US86562MBW91	2,750 SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 15.01.30	400.000,00	0,00	400.000,00	95,29	339.119,22	0,25
US883556BZ47	2,600 THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 01.10.29	200.000,00	0,00	200.000,00	95,78	170.427,05	0,12
US90520EAK73	2,100 MUFJ UNION BANK NA 09.12.22	300.000,00	0,00	300.000,00	103,06	275.064,50	0,20
USN6945AAL19	5,093 PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 15.01.30	453.000,00	0,00	453.000,00	91,76	369.833,79	0,27
USU11009AQ76	3,900 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 20.02.28	200.000,00	0,00	200.000,00	112,31	199.830,96	0,15
XS2067255328	5,625 HEALTH & HAPPINESS H&H 24.10.24	400.000,00	0,00	400.000,00	103,36	367.843,42	0,27
XS2078642183	3,500 VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 12.11.29	300.000,00	0,00	300.000,00	102,35	273.177,49	0,20
XS2099049699	2,875 SF HOLDING INVESTMENT LTD 20.02.30	200.000,00	0,00	200.000,00	96,80	172.241,10	0,13
XS2102867483	6,800 NEW METRO GLOBAL LTD 05.08.23	300.000,00	0,00	300.000,00	96,77	258.286,92	0,19
Summe USD						14.681.608,83	10,72
Devisenmittelkurs:	1,124000						

Strips

Währung: USD

US9127962A61	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 07.04.20	3.800.000,00	-3.100.000,00	700.000,00	99,85	621.847,70	0,45
US9127962B45	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 14.04.20	4.600.000,00	0,00	4.600.000,00	99,98	4.091.577,22	2,99
US912796TT67	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 07.05.20	1.000.000,00	0,00	1.000.000,00	99,82	888.109,11	0,65
US912796XB04	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 17.03.20	5.600.000,00	-1.000.000,00	4.600.000,00	100,00	4.092.395,03	2,99
US912796XC86	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 24.03.20	7.900.000,00	-6.100.000,00	1.800.000,00	99,95	1.600.554,72	1,17
US912796XD69	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 31.03.20	8.100.000,00	0,00	8.100.000,00	99,95	7.203.067,87	5,26
US912803FL21	0,000 UNITED STATES TREASURY STRIP 15.11.49	5.300.000,00	0,00	5.300.000,00	64,33	3.033.524,46	2,21
Summe USD						21.531.076,11	15,72
Devisenmittelkurs:	1,124000						

Gesamtsumme Wertpapiere

149.168.815,70 108,90

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

Währung: USD

US00206RCN08	3,400 AT&T INC 15.05.25	0,00	-500.000,00				
US00287YAY59	3,200 ABBVIE INC 14.05.26	0,00	-400.000,00				
US00652MAE21	4,375 ADANI PORTS & SPECIAL ECONOMIC ZONE 03.07.29	0,00	-200.000,00				
US00654GAA13	3,949 ADANI ELECTRICITY MUMBAI LTD 12.02.30	200.000,00	-200.000,00				
US00774MAB19	3,650 AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP 21.07.27	0,00	-150.000,00				
US032511BN64	5,550 ANADARKO PETROLEUM CORP 15.03.26	0,00	-300.000,00				
US03350WAC38	4,250 ANDEAVOR LOGISTICS LP / TESORO 01.12.27	0,00	-100.000,00				
US06051GHE26	2,917 BANK OF AMERICA CORP 05.03.24	0,00	-700.000,00				
US06051GHV41	3,194 BANK OF AMERICA CORP 23.07.30	700.000,00	-1.500.000,00				
US06738EAG08	2,875 BARCLAYS PLC 08.06.20	0,00	-400.000,00				
US09681LAE02	3,500 BOC AVIATION LTD 18.09.27	0,00	-200.000,00				
US101137AQ02	3,375 BOSTON SCIENTIFIC CORP 15.05.22	0,00	-400.000,00				
US11134LAF67	3,625 BROADCOM CORP / BROADCOM CAYMAN 15.01.24	100.000,00	-700.000,00				
US12543DAU46	5,125 CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 01.08.21	0,00	-200.000,00				
US126650CX62	4,300 CVS HEALTH CORP 25.03.28	0,00	-800.000,00				
US138616AA51	7,875 CANTOR FITZGERALD LP 15.10.19	0,00	-150.000,00				
US151020BB94	3,900 CELGENE CORP 20.02.28	0,00	-200.000,00				
US161175BK95	4,200 CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING 15.03.28	0,00	-600.000,00				
US161175BR49	5,050 CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING 30.03.29	0,00	-100.000,00				
US171798AE17	4,375 CIMAREX ENERGY CO 15.03.29	0,00	-300.000,00				
US172967LW98	4,075 CITIGROUP INC 23.04.29	0,00	-300.000,00				
US17308CC539	2,976 CITIGROUP INC 05.11.30	300.000,00	-300.000,00				
US20605PAK75	4,300 CONCHO RESOURCES INC 15.08.28	0,00	-200.000,00				
US210371AL43	5,150 EXELON CORP 01.12.20	0,00	-400.000,00				
US224044CH86	3,150 COX COMMUNICATIONS INC 15.08.24	0,00	-200.000,00				
US23422RAB87	7,750 DIAMOND RESORTS INTERNATIONAL INC 01.09.23	0,00	-100.000,00				
US25272KAG85	5,450 DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 15.06.23	0,00	-1.200.000,00				
US254687FL52	2,000 WALT DISNEY CO/THE 01.09.29	0,00	-700.000,00				
US292480AH37	3,900 ENABLE MIDSTREAM PARTNERS LP 15.05.24	0,00	-100.000,00				
US29279FAA75	6,250 ENERGY TRANSFER OPERATING LP 15.04.49	0,00	-300.000,00				

US34964CAB28	3,000 FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC 15.06.20	0,00	-200.000,00
US38141GWK65	2,942 GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 05.06.23	0,00	-1.000.000,00
US38141GWM22	2,905 GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 24.07.23	0,00	-700.000,00
US42225UAC80	3,375 HEALTHCARE TRUST OF AMERICA 15.07.21	0,00	-400.000,00
US42250PAA12	3,000 HEALTHPEAK PROPERTIES INC 15.01.30	100.000,00	-100.000,00
US44107TAQ94	6,000 HOST HOTELS & RESORTS LP 01.10.21	0,00	-100.000,00
US445658CF29	3,875 JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC 01.03.26	0,00	-100.000,00
US45326TAA60	6,000 INCITEC PIVOT FINANCE LLC 10.12.19	0,00	-100.000,00
US459506AJ06	3,400 INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES 25.09.20	0,00	-300.000,00
US459506AK78	4,450 INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES 26.09.28	0,00	-100.000,00
US460690BP43	4,650 INTERPUBLIC GROUP OF COS INC/THE 01.10.28	0,00	-100.000,00
US46647PAU03	3,797 JPMORGAN CHASE & CO 23.07.24	0,00	-300.000,00
US492386AU15	6,950 KERR-MCGEE CORP 01.07.24	0,00	-100.000,00
US50540RAQ56	3,600 LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS 01.02.25	0,00	-200.000,00
US55303XAG07	5,750 MGM GROWTH PROPERTIES OPERATING 01.02.27	0,00	-100.000,00
US565849AP16	4,400 MARATHON OIL CORP 15.07.27	0,00	-100.000,00
US56585ABC53	5,125 MARATHON PETROLEUM CORP 15.12.26	0,00	-100.000,00
US56585ABD37	3,800 MARATHON PETROLEUM CORP 01.04.28	0,00	-100.000,00
US57385LAA61	4,200 MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD 22.06.23	0,00	-100.000,00
US606822AA24	2,950 MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 01.03.21	0,00	-633.000,00
US606822AF11	3,187 MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 13.09.21	0,00	-300.000,00
US60687YAB56	2,632 MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 12.04.21	0,00	-400.000,00
US615369AB15	4,500 MOODY'S CORP 01.09.22	0,00	-200.000,00
US615394AM52	4,250 MOOG INC 15.12.27	100.000,00	-100.000,00
US628530BK28	4,550 MYLAN INC 15.04.28	0,00	-100.000,00
US651639AX42	2,800 NEWMONT CORP 01.10.29	0,00	-300.000,00
US65339BNB90	1,950 NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC 01.09.22	500.000,00	-500.000,00
US654740AZ24	2,650 NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP 13.07.22	0,00	-100.000,00
US674599CW33	2,900 OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 15.08.24	0,00	-300.000,00
US681936BJ87	4,375 OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC 01.08.23	0,00	-300.000,00
US68233JBE38	3,700 ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO LLC 15.11.28	0,00	-600.000,00
US68245XAC39	4,250 1011778 BC ULC / NEW RED FINANCE 15.05.24	0,00	-100.000,00
US71647NAZ24	5,750 PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 01.02.29	0,00	-600.000,00
US71654QAW24	6,000 PETROLEOS MEXICANOS 05.03.20	0,00	-446.000,00
US723787AJ62	7,500 PIONEER NATURAL RESOURCES CO 15.01.20	0,00	-700.000,00
US723787AL19	3,450 PIONEER NATURAL RESOURCES CO 15.01.21	0,00	-100.000,00
US75951AAJ79	3,850 RELIANCE STANDARD LIFE GLOBAL 19.09.23	0,00	-100.000,00
US80282KAU07	4,450 SANTANDER HOLDINGS USA INC 03.12.21	0,00	-300.000,00
US84756NAF69	3,500 SPECTRA ENERGY PARTNERS LP 15.03.25	0,00	-400.000,00
US85800TAA79	9,375 STEARNS HOLDINGS LLC 15.08.20	0,00	-97.000,00
US86562MAD20	3,782 SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 09.03.21	0,00	-400.000,00
US86562MAE03	2,058 SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 14.07.21	0,00	-200.000,00
US86562MBM10	2,696 SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 16.07.24	0,00	-300.000,00
US88160QAN34	5,250 ANDEAVOR LOGISTICS LP / TESORO 15.01.25	0,00	-100.000,00
US88167AAC53	2,200 TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 21.07.21	0,00	-200.000,00
US88167AAD37	2,800 TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 21.07.23	0,00	-500.000,00
US89153VAT61	2,829 TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 10.01.30	0,00	-300.000,00
US912796RN16	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 05.12.19	0,00	-300.000,00
US912796SW06	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 12.12.19	0,00	-700.000,00
US912796TE98	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 06.02.20	7.300.000,00	-7.300.000,00
US912796TF63	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 13.02.20	1.300.000,00	-1.300.000,00
US912796TL32	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 19.03.20	500.000,00	-500.000,00
US912796TR02	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 16.04.20	500.000,00	-500.000,00
US912796WC95	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 05.11.19	600.000,00	-600.000,00
US912796WD78	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 12.11.19	600.000,00	-600.000,00
US912796WV76	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 03.03.20	1.800.000,00	-1.800.000,00
US912810SJ88	2,250 UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 15.08.49	700.000,00	-700.000,00
US912810SK51	2,375 UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 15.11.49	1.218.000,00	-1.218.000,00
US912828YS30	1,750 UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 15.11.29	3.300.000,00	-3.300.000,00
US912828Z948	1,500 UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 15.02.30	2.471.000,00	-2.471.000,00
US928563AC98	3,900 VMWARE INC 21.08.27	0,00	-400.000,00
US92890HAC60	3,750 WEA FINANCE LLC / WESTFIELD UK & 17.09.24	0,00	-300.000,00
US94988J5R41	3,550 WELLS FARGO BANK NA 14.08.23	0,00	-800.000,00
US95000U2A01	3,584 WELLS FARGO & CO 22.05.28	100.000,00	-400.000,00
US95000U2K82	2,164 WELLS FARGO & CO 11.02.26	400.000,00	-400.000,00
US96949LAE56	4,850 WILLIAMS COS INC/THE 01.03.48	0,00	-200.000,00
US98310WAN83	5,750 WYNDHAM DESTINATIONS INC 01.04.27	0,00	-300.000,00
US98956PAC68	3,375 ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC 30.11.21	0,00	-200.000,00
USU5521WAM74	5,250 MPLX LP 15.01.25	100.000,00	-100.000,00
USU5521WAP06	4,250 MPLX LP 01.12.27	100.000,00	-100.000,00
USU8029KAM46	3,244 SANTANDER HOLDINGS USA INC 05.10.26	300.000,00	-300.000,00
XS1164776020	7,500 COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD 09.03.20	0,00	-200.000,00
XS1538864825	3,950 VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 23.12.19	0,00	-200.000,00
XS1796077946	4,700 ING GROEP NV 22.03.28	0,00	-200.000,00
XS1985100509	3,266 QNB FINANCE LTD 02.05.22	0,00	-800.000,00