

Allianz PIMCO Mortgage

ISIN: AT0000675459 (A)

ISIN: AT0000675467 (T)

Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH

Halbjahresbericht

vom 15.09.2019 – 14.03.2020

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	%
Amtlich notierte Wertpapiere		
Anleihen		
GBP	1.662.905,70	1,07
USD	132.268.212,78	85,28
Zerobonds		
USD	48,35	0,00
Nicht notierte Wertpapiere		
Anleihen		
USD	2.491.142,73	1,61
Neuemissionen		
Anleihen		
USD	5.090.642,45	3,28
Summe Wertpapiere	141.512.952,01	91,24
 <u>2. Derivative Produkte</u>		
Devisentermingeschäfte		
EUR	3.217.215,97	2,07
Forwards		
USD	-256.411,24	-0,17
Summe Derivative Produkte	2.960.804,73	1,90
 <u>3. Bankguthaben / -verbindlichkeiten</u>		
EUR	-20.637,14	-0,01
Fremdwährung	14.011.127,03	9,03
Collaterals		
USD	-3.837.188,58	-2,47
Summe Bankguthaben / -verbindlichkeiten	10.153.301,31	6,55
 <u>4. Abgrenzungen</u>		
Anteilige Erträge (aus Wertpapieren/Bankguthaben und Aufwendungen)	464.667,84	0,31
Fondsvermögen	155.091.725,89	100,00

Darstellung der Fondsdaten zum Berichtsstichtag:

Fondsdaten in EUR	per 14.09.2019	per 14.03.2020
Fondsvolumen gesamt	146.784.262,86	155.091.725,89
Errechneter Wert je Ausschüttungsanteil	56,83	56,51
Ausgabepreis je Ausschüttungsanteil	58,82	58,49
Errechneter Wert je Thesaurierungsanteil	81,99	82,21
Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil	84,86	85,09
Ausschüttung/Auszahlung in EUR		per 15.11.2019
Ausschüttung je Ausschüttungsanteil		0,5000
Auszahlung je Thesaurierungsanteil		0,0000

Umlaufende Anteile zum Berichtsstichtag:

Ausschüttungsanteile	2.506.670
Thesaurierungsanteile	163.462
Gesamt umlaufende Anteile per 14.03.2020	2.670.132

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	147.335.968,00	60,80	0,84	2.363.653	1,87
14.09.17	144.861.436,60	59,07	1,2000	2.401.587	-1,47
14.09.18	151.791.963,27	55,54	0,8000	2.449.441	-4,01
14.09.19	146.784.262,86	56,83	0,5000	2.484.848	3,84
14.03.20	155.091.725,89	56,51	-	2.506.670	-

Datum	Errechneter Wert je Thesaurierungs- anteil	Zur Thesaurierung verwendeter Betrag	Auszahlung je Anteil	Anteile	Wertent- wicklung in %
14.09.16	84,62	0,86	0,31	42.931	1,84
14.09.17	83,06	3,03	0,8154	36.235	-1,48
14.09.18	78,99	-3,30	0,0000	199.474	-3,95
14.09.19	81,99	-2,70	0,0000	67.848	3,80
14.03.20	82,21	-	-	163.462	-

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 nicht eingesetzt werden. Pensionsgeschäfte wurden deshalb nicht eingesetzt.

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 für den Allianz PIMCO Mortgage per 14. März 2020

ISIN	Zugang	Abgang	Stand am 13.03.2020	Tageskurs	Kurswert EUR	Anteil in %
Amtlich notierte Wertpapiere						
Anleihen						
Währung: GBP						
XS2033256145	1,761 HAWKSMOOR MORTGAGES 25.05.53	0,00	-121.152,06	1.478.847,94	99,65304	1.662.905,70
	Summe GBP					1.662.905,70
	Devisenmittelkurs:	0,886230				1,07
Währung: USD						
US152314EQ97	1,927 CENTEX HOME EQUITY LOAN TRUST 2002 25.01.32	0,00	-379,24	5.547,50	96,84840	4.779,95
US17307GXP89	3,840 CITIGROUP MORTGAGE LOAN TRUST INC 25.09.35	0,00	-9.413,34	50.537,65	103,97114	46.747,83
US22541NAD12	2,227 HOME EQUITY ASSET TRUST 25.11.32	0,00	0,00	1.282,98	94,81598	1.082,27
US31281BDJ61	5,500 FREDDIE MAC GOLD POOL 01.08.33	0,00	-12.558,20	214.584,89	112,59250	214.952,40
US3128MJ2S87	3,500 FREDDIE MAC GOLD POOL 01.10.47	0,00	-7.833,52	55.848,67	104,48059	51.913,72
US3128MJYN41	3,500 FREDDIE MAC GOLD POOL 01.08.46	0,00	-15.660,39	113.416,03	104,60321	105.548,76
US31300MLR24	4,297 FREDDIE MAC NON GOLD POOL 01.12.34	0,00	-106.585,50	519.566,07	102,19369	472.387,68
US31307WA469	3,500 FREDDIE MAC GOLD POOL 01.06.33	0,00	-16.686,44	166.524,38	105,49691	156.297,22
US31307WUJ44	3,500 FREDDIE MAC GOLD POOL 01.09.33	0,00	-42.142,06	240.935,59	105,37768	225.882,86
US31326MVK51	3,544 FREDDIE MAC NON GOLD POOL 01.06.48	0,00	-49.791,41	105.135,70	104,44308	97.693,02
US3132WJQK04	3,500 FREDDIE MAC GOLD POOL 01.12.46	0,00	-23.179,62	256.218,63	105,76312	241.089,69
US3132XS3V08	3,500 FREDDIE MAC GOLD POOL 01.09.47	0,00	-40.017,04	410.518,02	104,48416	381.607,03
US3132XY5K98	4,000 FREDDIE MAC GOLD POOL 01.05.48	0,00	-10.628,36	86.521,01	107,03567	82.391,76
US3132YORE24	3,500 FREDDIE MAC GOLD POOL 01.06.48	19.685,03	-33.247,24	129.703,93	103,50918	119.444,37
US3132Y1HU58	3,500 FREDDIE MAC GOLD POOL 01.07.48	0,00	-16.831,32	81.340,73	103,50918	74.906,69
US3133TMG268	1,777 FREDDIE MAC STRUCTURED PASS-THROUGH 25.12.29	0,00	-2.088,79	51.056,26	97,41078	44.247,59
US3133TNGH17	1,767 FREDDIE MAC STRUCTURED PASS-THROUGH 25.05.30	0,00	-1.865,73	27.794,58	99,32616	24.561,64
US31347A3D43	3,336 FREDDIE MAC NON GOLD POOL 01.05.48	0,00	-37.821,73	216.800,31	103,79923	200.210,90
US3136ABN252	4,523 FANNIE MAE REMICS 25.02.43	0,00	-111.639,44	676.190,16	113,16390	79.193,03
US3136AC5B37	4,523 FANNIE MAE REMICS 25.07.42	0,00	-41.157,90	354.049,01	12,89971	40.632,82
US3136AKAV57	2,500 FANNIE MAE REMICS 25.04.43	0,00	-158.215,44	1.204.796,08	102,80336	1.101.931,37
US31378JDP93	6,500 FANNIE MAE POOL 01.10.27	0,00	-1.833,66	31.222,23	107,41779	29.838,28
US3137ABFJ58	1,236 FREDDIE MAC MULTIFAMILY STRUCTURED 25.06.21	0,00	-14.860,92	992.114,27	0,86961	7.675,70
US3137ADTK32	1,149 FREDDIE MAC MULTIFAMILY STRUCTURED 25.04.21	0,00	-24.254,83	2.229.829,37	0,78999	15.672,15
US3137AX5M12	2,500 FREDDIE MAC REMICS 15.12.27	0,00	-211.137,43	1.678.607,86	6,72978	100.504,13
US3137B5GQ09	4,000 FREDDIE MAC REMICS 15.08.42	0,00	-27.641,65	153.198,34	9,37478	12.777,58
US3137BGCN75	3,500 FREDDIE MAC REMICS 15.03.43	0,00	-41.707,81	202.862,48	4,74260	8.559,56
US3137FMTU67	0,912 FREDDIE MAC MULTIFAMILY STRUCTURED 25.04.34	0,00	-16.864,22	20.780.466,51	10,25789	1.896.474,73
US3138EJYQ53	5,500 FANNIE MAE POOL 01.11.39	0,00	-13.853,06	749.092,86	110,62117	737.237,77
US3138ELXR91	6,000 FANNIE MAE POOL 01.11.40	0,00	-17.533,52	213.005,01	120,17393	227.737,08
US3138EPJW56	2,839 FANNIE MAE POOL 01.06.22	0,00	-53.036,41	212.565,34	103,40213	195.549,01
US3138ETY911	4,500 FANNIE MAE POOL 01.01.42	0,00	-20.817,77	238.819,93	110,29640	234.350,34
US3138NXH422	3,000 FANNIE MAE POOL 01.01.43	0,00	-9.789,65	193.152,70	104,27280	179.186,58
US3138XS5B56	4,000 FANNIE MAE POOL 01.04.44	0,00	-13.736,63	1.100.498,78	109,26675	1.069.821,43
US31395HHV50	3,253 FREDDIE MAC STRUCTURED PASS-THROUGH 25.10.44	0,00	-28.046,35	248.862,85	99,39570	220.070,26
US31395M2F53	3,252 FREDDIE MAC STRUCTURED PASS-THROUGH 25.02.45	0,00	-38.072,22	357.135,30	98,80390	313.935,59
US31396PQR54	2,047 FANNIE MAE REMICS 25.02.37	0,00	-15.484,50	367.463,88	100,05902	327.118,10
US31405WJA45	5,500 FANNIE MAE POOL 01.08.34	0,00	-1.355,81	36.402,58	115,62527	37.447,14
US31406MJ560	4,500 FANNIE MAE POOL 01.06.35	0,00	-294,17	14.026,99	107,56720	13.423,88
US31408FS595	5,500 FANNIE MAE POOL 01.12.35	0,00	0,00	66.735,50	114,30055	67.863,91
US3140E7NL01	3,500 FANNIE MAE POOL 01.01.46	0,00	-148.913,42	1.229.547,02	107,87042	1.179.997,84
US3140E9GZ36	3,000 FANNIE MAE POOL 01.12.35	0,00	-108.204,48	393.030,77	102,03114	356.773,82
US3140FEEB62	3,500 FANNIE MAE POOL 01.10.46	0,00	-17.369,14	208.587,14	106,84111	198.271,18
US3140H6DG12	4,000 FANNIE MAE POOL 01.02.48	0,00	-21.670,61	130.350,31	100,61219	124.159,00
US3140HJJW24	5,500 FANNIE MAE POOL 01.08.48	0,00	-64.557,08	275.441,72	109,40111	268.092,80
US3140HNVQ20	4,500 FANNIE MAE POOL 01.09.48	0,00	-49.507,74	421.497,97	107,25284	402.196,20
US3140J8LH49	4,000 FANNIE MAE POOL 01.03.38	0,00	-37.659,73	424.153,27	109,26878	412.337,27
US3140JAUP17	3,525 FANNIE MAE POOL 01.11.48	3.197.972,44	-75.753,00	3.122.219,44	104,15926	2.893.310,12
US31410GN665	6,500 FANNIE MAE POOL 01.03.37	0,00	-2.219,86	23.752,81	122,28210	25.841,13
US31410K4E12	5,000 FANNIE MAE POOL 01.03.23	0,00	-4.243,41	10.636,11	103,42465	9.786,80
US31410LFB36	4,500 FANNIE MAE POOL 01.08.41	0,00	-32.993,36	348.728,46	111,61960	346.307,22
US31410WJ744	4,500 FANNIE MAE POOL 01.05.37	0,00	-237,34	12.863,34	108,28813	12.392,77
US31411EV794	6,000 FANNIE MAE POOL 01.01.37	0,00	-1.874,56	116.256,67	113,57133	117.468,19
US31411KE417	6,000 FANNIE MAE POOL 01.03.37	0,00	-763,85	9.941,12	120,43549	10.651,81
US31411NZU44	5,000 FANNIE MAE POOL 01.02.22	0,00	-315,84	902,78	103,17870	828,72
US31415RU773	5,000 FANNIE MAE POOL 01.07.23	0,00	-1.541,47	7.131,72	105,06538	6.666,34
US31416QDT94	4,000 FANNIE MAE POOL 01.10.39	0,00	-7.075,03	123.447,37	108,16120	118.791,96
US31416VQN72	5,500 FANNIE MAE POOL 01.02.37	0,00	-7.256,02	81.265,68	118,65259	85.786,33
US31417SQS22	4,000 FANNIE MAE POOL 01.05.40	0,00	-888,75	51.656,62	108,23567	49.742,78
US31418AMS41	4,000 FANNIE MAE POOL 01.11.32	0,00	-58.655,62	719.201,32	108,56396	694.656,07
US36176QAC87	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.09.41	0,00	-153,28	10.923,77	108,33067	10.528,28
US36176QEN07	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.09.41	0,00	-1.337,39	9.487,31	108,33065	9.143,83
US36176TN959	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.11.41	0,00	-287,02	17.713,33	110,10053	17.350,95
US36176UP416	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.01.42	0,00	-224,31	16.774,04	108,33066	16.166,75
US36176VW907	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.02.43	0,00	-252,29	18.270,31	107,27913	17.437,93
US36176XP60	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.05.42	0,00	-6.458,13	59.767,44	107,27916	57.044,49
US36177JRX99	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.01.42	0,00	-7.465,60	24.488,52	108,33070	23.601,94
US36177NWU08	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.02.42	0,00	-4.871,87	12.776,00	107,89461	12.263,89
US36177RDQ11	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.43	0,00	-658,88	38.255,24	107,07150	36.441,69
US36178D7M79	3,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.43	0,00	-9.643,31	96.221,47	107,07151	91.659,95

US36202EXN48	6,000 GINNIE MAE II POOL 20.11.38	0,00	-4.485,77	17.357,50	110,83268	17.115,46	0,01
US36202EYF05	6,000 GINNIE MAE II POOL 20.12.38	0,00	-1.293,88	7.349,21	110,69544	7.237,76	0,00
US36202EZ512	6,000 GINNIE MAE II POOL 20.02.39	0,00	-28,04	1.876,69	109,79064	1.833,12	0,00
US36202EZA09	6,000 GINNIE MAE II POOL 20.01.39	0,00	-1.658,08	9.226,10	111,58745	9.159,40	0,01
US36202EZQ50	5,500 GINNIE MAE II POOL 20.02.24	0,00	-2.316,05	7.272,95	107,66855	6.966,80	0,00
US36202F2W59	2,500 GINNIE MAE II POOL 20.01.27	0,00	-1.551,25	22.699,07	103,07220	20.815,33	0,01
US36202FAQ90	6,000 GINNIE MAE II POOL 20.08.39	0,00	-0,59	40,73	113,25804	41,04	0,00
US36202FAV85	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.08.39	0,00	-8.288,13	72.390,68	112,43725	72.414,67	0,05
US36202FBB13	5,500 GINNIE MAE II POOL 20.09.39	0,00	-1,20	50,64	107,52370	48,44	0,00
US36202FBJ49	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.09.39	0,00	-1.076,16	9.873,72	112,43723	9.876,99	0,01
US36202FDX15	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.01.40	0,00	-10.981,24	101.142,41	112,43725	101.175,93	0,07
US36202FEP71	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.03.25	0,00	-13.827,79	153.800,34	104,39314	142.844,31	0,09
US36202FEV40	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.03.40	0,00	-75,33	4.784,55	108,52264	4.619,50	0,00
US36202FGE07	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.05.40	0,00	-2.275,28	19.984,81	112,11630	19.934,37	0,01
US36202FGT75	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.06.40	0,00	-691,16	50.653,32	110,58545	49.835,58	0,03
US36202FHC32	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.07.25	0,00	-627,23	7.391,16	107,62884	7.077,42	0,00
US36202FHR01	6,000 GINNIE MAE II POOL 20.07.40	0,00	-635,23	54.903,15	110,48392	53.967,22	0,03
US36202FJR82	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.08.40	0,05	-3.939,84	37.413,90	112,11631	37.319,48	0,02
US36202FK545	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.10.25	0,00	-145,36	699,27	107,16032	666,67	0,00
US36202FK883	6,000 GINNIE MAE II POOL 20.01.24	0,00	-12.609,11	35.390,85	101,11820	31.838,60	0,02
US36202FKP08	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.09.40	0,00	-40.983,06	388.086,16	112,11633	387.106,70	0,25
US36202FL618	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.11.40	0,00	-141.855,52	1.208.490,58	107,40803	1.154.818,40	0,74
US36202FLQ71	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.10.40	0,00	-3.028,84	34.515,45	112,11631	34.428,34	0,02
US36202FM459	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.12.40	1.019.776,20	-93.781,40	925.994,80	107,40803	884.868,99	0,57
US36202FM947	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.12.40	0,00	-24.559,64	216.700,39	112,11633	216.153,48	0,14
US36202FMC76	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.11.40	0,00	-12.061,56	157.559,52	112,11633	157.161,87	0,10
US36202FPB66	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.01.41	0,00	-146,62	1.217,78	107,40761	1.163,69	0,00
US36202FPH37	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.01.41	0,00	-22.962,81	229.892,12	112,11632	229.311,91	0,15
US36202FQA74	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.02.41	0,00	-320,47	2.119,37	107,40786	2.025,24	0,00
US36202FRA65	5,500 GINNIE MAE II POOL 20.08.24	0,00	-2.513,93	4.308,61	100,09562	3.836,95	0,00
US36202FRX68	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.03.41	0,00	-136,65	9.172,77	110,10055	8.985,12	0,01
US36202FST48	5,500 GINNIE MAE II POOL 20.02.26	0,00	-2.823,39	3.915,48	102,19462	3.559,97	0,00
US36202FUR53	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.06.41	0,00	-387,75	1.043,76	107,46819	997,96	0,00
US36202FUW49	6,000 GINNIE MAE II POOL 20.06.41	0,00	-1.268,96	122.822,00	110,36374	120.596,93	0,08
US36202FVY95	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.07.41	0,00	-1.160,11	95.245,99	112,07834	94.973,42	0,06
US36202FX688	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.10.41	0,00	-157,23	793,39	107,46795	758,58	0,00
US36202FXR27	6,000 GINNIE MAE II POOL 20.09.41	0,00	-691,48	66.158,50	109,95621	64.720,09	0,04
US36202FY348	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.11.41	0,00	-138,63	746,60	107,46852	713,84	0,00
US36202FZL39	3,500 GINNIE MAE II POOL 20.11.26	0,00	-6.896,28	92.549,00	102,85717	84.691,53	0,05
US36202UBV44	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.08.33	0,00	-445,95	16.467,03	106,63117	15.621,88	0,01
US36202VAQ41	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.09.33	0,00	-57,18	2.230,88	114,87754	2.280,05	0,00
US36202VV739	6,000 GINNIE MAE II POOL 20.04.34	0,00	-233,12	10.770,56	115,87438	11.103,49	0,01
US36203SW780	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.09.23	0,00	-205,61	1.345,98	104,12988	1.246,95	0,00
US36204DX382	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.07.41	0,00	-991,82	10.543,65	108,33062	10.161,92	0,01
US36207KEG13	7,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.28	0,00	-6,31	144,96	107,94672	139,22	0,00
US36209FPY96	7,500 GINNIE MAE I POOL 15.05.29	0,00	-3,97	67,35	105,61294	63,28	0,00
US3620A44M14	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.11.39	0,00	-177,21	10.128,54	108,24564	9.754,18	0,01
US3620A56K03	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.06.24	0,00	-1.451,02	9.508,38	105,78626	8.948,90	0,01
US3620A5H775	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.11.40	0,00	-13.463,54	36.622,66	108,19872	35.253,78	0,02
US3620A5YT01	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.39	0,00	-23.956,86	146.074,96	118,75466	154.333,48	0,10
US3620A6CA31	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.06.39	0,00	-149,96	6.023,68	108,24562	5.801,04	0,00
US3620A7JM88	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.09.40	0,00	-150,51	9.092,38	108,19872	8.752,53	0,01
US3620A7KW42	5,250 GINNIE MAE II POOL 20.08.39	0,00	-1.193,89	87.768,69	107,59878	84.019,61	0,05
US3620AAN208	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.25	0,00	-13.354,26	105.611,46	104,29666	97.997,53	0,06
US3620ABC464	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.12.39	0,00	-174,94	11.197,26	108,24573	10.783,42	0,01
US3620AFYS05	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.24	0,00	-2.377,94	19.786,65	106,48134	18.744,74	0,01
US3620AGJD83	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.07.41	0,00	-2.302,15	22.092,53	108,33066	21.292,69	0,01
US3620AKW513	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.40	0,00	-31,64	2.444,23	109,59607	2.383,26	0,00
US3620ALT467	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.08.40	0,00	-1.603,33	7.653,81	108,19873	7.367,73	0,00
US3620AMCH39	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.05.40	0,00	-7.066,58	51.254,31	108,19872	49.338,53	0,03
US3620AMD584	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.06.40	0,00	-176.811,41	1.448.605,26	110,24851	1.420.877,02	0,92
US3620AMFV95	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.07.40	0,00	-5.964,59	30.124,56	108,19873	28.998,57	0,02
US3620ANEP10	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.35	0,00	-1.021,79	4.542,63	114,28507	4.618,82	0,00
US3620ANGU86	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.03.40	0,00	-1.354,22	3.557,22	108,24556	3.425,74	0,00
US3620AQYX54	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.02.40	0,00	-373,73	22.958,49	108,19870	22.100,35	0,01
US3620ARUP40	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.12.40	0,00	-76.704,04	924.125,05	108,19874	889.583,32	0,57
US3620ARYL99	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.01.41	0,00	-57.843,72	464.160,62	108,19874	446.811,33	0,29
US3620AY6G61	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.09.41	0,00	-3.990,13	46.440,24	108,33070	44.758,93	0,03
US3620AYQ250	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.10.40	0,00	-146,99	9.426,48	108,19871	9.074,14	0,01
US3620C0F299	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.07.41	0,00	-139,50	10.095,00	108,33065	9.729,52	0,01
US3620C0WG90	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.02.39	0,00	-33,11	2.084,11	110,82045	2.054,82	0,00
US3620C0XJ21	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.24	0,00	-221,04	1.789,88	104,60981	1.665,83	0,00
US3620C1A710	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.39	0,00	-5.133,63	5.711,12	110,97718	5.638,83	0,00
US3620C1E696	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.08.30	0,00	-136.704,56	620.546,64	107,73524	594.793,08	0,38
US3620C1G261	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.08.20	0,00	-9.255,52	6.856,74	100,03996	6.102,74	0,00
US3620C3B920	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.09.25	0,00	-13.010,69	133.892,01	105,23155	125.352,88	0,08
US3620C6E334	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.41	0,00	-69,77	3.837,72	109,52725	3.739,63	0,00
US36210B4R31	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.04.24	0,00	-1.547,68	11.468,06	106,45645	10.861,65	0,01
US36210JHG67	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.29	0,00	-200,60	2.855,95	111,54152	2.834,14	0,00
US36210SE791	6,000 GINNIE MAE I POOL 15.09.29	0,00	-3.492,89	81.923,96	119,10607	86.811,75	0,06
US36211BBF04	7,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.29	0,00	-26,12	351,82	103,77321	324,82	0,00
US36211RSP54	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.03.35	0,00	-97,33	1.806,68	116,71353	1.876,01	0,00
US36211V6Q85	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.01.24	0,00	-2.723,94	8.048,98	102,71587	7.355,50	0,00
US36212C3P46	7,500 GINNIE MAE I POOL 15.09.30	0,00	-11,37	256,33	108,71601	247,93	0,00
US36212EJD04	7,500 GINNIE MAE I POOL 15.09.30	0,00	-21,23	695,70	110,01445	680,93	0,00
US36212USE28	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.03.36	0,00	-839,22	9.192,08	117,05055	9.572,40	0,01

US36212USJ15	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.03.36	0,00	-240,72	13.963,83	114,00026	14.162,63	0,01
US36212UTA96	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.08.36	0,00	-108,09	5.521,49	117,32067	5.763,21	0,00
US36212WX286	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.04.40	0,00	-303,82	14.495,63	108,19870	13.953,81	0,01
US36213CUF57	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.08.20	0,00	-347,80	237,36	100,01264	211,20	0,00
US36213CUC80	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.11.20	0,00	-307,80	75,60	100,05291	67,30	0,00
US36213RUQ81	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.33	0,00	-23,29	740,47	115,92907	763,72	0,00
US36213UV15	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.06.22	0,05	-835,19	3.725,94	100,94204	3.346,12	0,00
US36225BE613	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.06.29	0,00	-198,31	2.197,29	111,89602	2.187,44	0,00
US36225BUE63	7,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.32	0,00	-10.972,32	103.224,99	118,04739	108.411,39	0,07
US36225CM945	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.03.30	0,00	-10.600,50	279.294,48	101,87557	253.143,10	0,16
US36225CMN38	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.01.30	0,00	-344,96	5.857,89	102,62539	5.348,47	0,00
US36225CMY92	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.02.30	0,00	-270,82	6.467,96	102,08967	5.874,66	0,00
US36225CQ748	3,125 GINNIE MAE II POOL 20.12.30	0,00	-2.033,25	41.144,36	102,12909	37.384,66	0,02
US36225CTZ94	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.01.32	0,00	-1.210,93	7.343,06	102,80265	6.716,07	0,00
US36225CZD19	3,750 GINNIE MAE II POOL 20.09.33	0,00	-120,65	4.461,04	103,72357	4.116,68	0,00
US36225CZF66	3,750 GINNIE MAE II POOL 20.08.33	0,00	-774,24	25.068,68	103,69741	23.127,73	0,01
US36222A24S85	3,500 GINNIE MAE II POOL 20.02.48	0,00	-73.640,22	1.204.748,63	106,50307	1.141.542,95	0,74
US36222A25E80	3,500 GINNIE MAE II POOL 20.02.48	0,00	-50.507,53	1.047.072,92	106,85843	955.449,94	0,64
US36222A25Q11	3,500 GINNIE MAE II POOL 20.02.48	0,00	-392.082,85	4.115.344,00	105,99308	3.880.765,14	2,50
US36222A2N323	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.03.45	0,00	-6.538,45	189.965,11	109,28208	184.695,57	0,12
US36222A2P229	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.08.45	0,00	-15.184,84	383.902,27	109,99760	375.696,88	0,24
US36222A2PA44	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.07.45	0,00	-44.950,67	247.843,53	109,27175	240.945,69	0,16
US36222A2PB27	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.06.45	0,00	-50.167,64	354.603,24	110,28778	347.939,55	0,22
US36222A2PD82	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.05.45	0,00	-14.387,21	229.964,99	109,77574	224.595,87	0,14
US36222A2SC72	3,000 GINNIE MAE II POOL 20.02.46	0,00	-37.838,30	336.442,62	103,88224	310.946,73	0,20
US36222A2U914	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.07.46	0,00	-15.010,37	541.035,74	109,99760	529.471,83	0,34
US36222A2WH14	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.08.41	0,00	-68.904,77	847.801,88	112,22531	846.484,22	0,55
US36222AAA022	3,500 GINNIE MAE II POOL 20.03.48	0,00	-562.814,90	8.661.510,30	106,50307	8.207.094,72	5,29
US36230KL411	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.10.40	0,00	-787,06	8.420,80	108,19871	8.106,05	0,01
US36230KL668	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.10.40	0,00	-9.933,60	109.344,00	108,19873	105.256,96	0,07
US36230LQ96	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.10.40	0,00	-78.354,76	784.192,11	110,14954	768.491,09	0,50
US36230N3A18	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.08.42	0,00	-291,78	19.364,64	107,03297	18.439,99	0,01
US36230RXE16	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.12.40	0,00	-4.779,39	2.411,30	108,19842	2.321,17	0,00
US36230ULU15	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.02.41	0,00	-80.916,92	693.373,72	110,14954	679.491,05	0,44
US36230JMY28	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.12.40	0,00	-38.362,38	264.830,27	108,52266	255.694,70	0,16
US36241KJZ21	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.02.21	0,00	-218,46	93,28	100,72899	83,59	0,00
US36241KL715	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.37	0,00	-413,21	4.082,14	118,07823	4.288,36	0,00
US36241KQP65	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.02.38	0,00	-228,36	2.599,82	118,01432	2.729,68	0,00
US36241KQZ48	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.02.38	0,00	-343,90	4.429,73	117,83345	4.643,86	0,00
US36241KRP56	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.03.38	0,00	-8.455,43	46.776,61	117,02545	48.701,55	0,03
US36241KSB51	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.38	0,00	-338,90	2.912,69	118,27005	3.064,80	0,00
US36241KSV16	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.05.38	0,00	-200,81	1.829,77	118,44822	1.928,23	0,00
US36241KUS58	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.02.36	0,00	-184,49	3.592,47	117,79055	3.764,76	0,00
US36241KVS40	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.38	0,00	-2.271,93	21.456,16	117,29280	22.390,15	0,01
US36241KX454	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.12.23	0,00	-10.388,34	61.204,30	106,31284	57.889,71	0,04
US36241KYC60	9,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.24	0,00	-3.448,19	2.467,32	103,05514	2.262,19	0,00
US36241LC209	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.39	0,00	-438,51	5.133,96	118,23875	5.400,65	0,00
US36241LG267	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.40	0,00	-161.007,47	855.465,69	110,24851	839.090,93	0,54
US36241LGU44	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.39	0,00	-5.131,02	55.602,40	118,31398	58.527,94	0,04
US36241LGZ31	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.02.40	0,00	-666,75	13.696,53	119,30635	14.538,10	0,01
US36241LK541	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.07.40	0,00	-6.898,45	110.162,55	108,19874	106.044,92	0,07
US36241LL382	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.08.40	0,00	-841,95	7.692,39	108,19868	7.404,86	0,00
US36241LL796	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.07.40	0,00	-12.452,20	109.327,50	112,11632	109.051,57	0,07
US36241LS239	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.01.41	0,00	-108.964,39	1.261.465,21	108,19874	1.214.314,46	0,78
US36241LSM99	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.12.40	0,00	-9.273,96	104.468,55	112,11633	104.204,89	0,07
US36241LU870	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.04.41	0,00	-1.468,74	13.791,79	108,19868	13.276,27	0,01
US36241LWV26	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.07.41	0,00	-2.326,79	26.950,54	108,19873	25.943,19	0,02
US36290QBM69	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.33	0,00	-1.063,19	32.101,08	116,29799	33.214,33	0,02
US36290QJD88	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.06.33	0,00	-263,43	3.839,80	116,21465	3.970,12	0,00
US36290R5V16	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.33	0,00	-261,89	5.822,26	116,80258	6.050,31	0,00
US36290TWR66	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.36	0,00	-11,13	668,07	115,25528	685,04	0,00
US36290UAT34	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.05.37	0,00	-253,63	2.359,71	115,69939	2.428,98	0,00
US36290UCK07	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.05.22	0,00	-390,77	1.820,94	100,53434	1.628,71	0,00
US36290UDH68	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.37	0,00	-175,02	9.164,52	122,56190	9.993,07	0,01
US36290UHU34	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.37	0,00	-1.464,34	14.586,62	128,78995	16.713,61	0,01
US36290VY83	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.03.34	0,00	-864,71	1.864,44	107,73905	1.787,13	0,00
US36290VJ218	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.36	0,00	-89,77	4.961,13	120,64813	5.325,19	0,00
US36290VNU43	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.02.22	0,00	-1.676,09	5.573,34	100,89731	5.002,98	0,00
US36291AV223	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.33	0,00	-117,06	4.110,07	116,92550	4.275,55	0,00
US36291FPX05	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.04.45	0,00	-5.024,62	134.494,18	109,99760	131.619,55	0,08
US36291FS335	3,500 GINNIE MAE II POOL 20.10.43	0,00	-71.397,06	1.168.143,76	106,00078	1.101.638,37	0,71
US36291FVS46	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.03.34	0,00	-76,46	2.694,53	117,46130	2.815,86	0,00
US36291NGC92	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.03.37	0,00	-150,21	9.677,28	112,86824	9.717,59	0,01
US36291QRB22	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.05.46	0,00	-4.914,71	375.656,84	109,99760	367.627,68	0,24
US36291UJA43	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.09.21	0,00	-13.111,66	12.600,82	100,32863	11.247,54	0,01
US36291XAL38	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.05.35	0,00	-6.025,95	6.535,81	112,38117	6.534,72	0,00
US36291XAM11	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.05.35	0,00	-458,68	3.848,73	117,60763	4.027,05	0,00
US36291YEU73	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.05.35	0,00	-38,05	1.629,94	112,16487	1.626,53	0,00
US36291YWN39	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.36	0,00	-2.552,84	3.579,04	113,51508	3.614,55	0,00
US36292CFF68	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.10.20	0,00	-513,41	451,71	100,15718	402,51	0,00
US36292CL855	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.06.20	0,00	-887,34	183,49	100,03270	163,30	0,00
US36292CMK70	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.06.35	0,00	-55,83	2.369,14	115,25575	2.429,33	0,00
US36292DBU54	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.08.35	0,00	-5.833,33	245.250,10	117,75533	256.935,11	0,17
US36292FNL75	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.08.21	0,00	-1.116,28	2.728,04	102,15869	2.479,48	0,00
US36292GPL31	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.35	0,00	-2.543,78	5.935,27	117,99295	6.230,60	0,00
US36292HSB05	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.35	0,00	-61,57	2.462,42	111,29661	2.438,25	0,00

US36292JQ693	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.35	0,00	-44,85	2.236,33	117,37713	2.335,36	0,00
US36292KPH31	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.36	0,00	-1.742,31	2.126,22	112,39712	2.126,17	0,00
US36292L2T04	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.36	0,00	-1.057,34	1.939,23	114,80227	1.980,68	0,00
US36292L4Q47	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.36	0,00	-134,31	7.358,44	116,70123	7.640,03	0,00
US36292LGP31	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.36	0,00	-234,80	8.609,36	111,01789	8.503,50	0,01
US36292MYP12	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.05.36	0,00	-25,03	1.525,86	113,81065	1.545,01	0,00
US36294NZY74	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.06.36	0,00	-50,22	1.236,91	107,54133	1.183,44	0,00
US36294PEC32	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.21	0,00	-501,66	1.230,48	100,33564	1.098,41	0,00
US36294SA231	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.36	0,05	-992,19	12.405,14	121,30237	13.387,66	0,01
US36294SG436	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.36	0,00	-54,35	3.235,31	119,15410	3.429,72	0,00
US36294SPH49	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.03.22	0,00	-1.059,45	4.127,90	102,74207	3.773,21	0,00
US36294TFF75	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.36	0,00	-33,13	2.070,59	115,47871	2.127,30	0,00
US36294W2K30	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.06.37	0,00	-97,34	4.935,26	116,54465	5.117,24	0,00
US36294WPS16	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.36	0,00	-137,53	7.294,21	114,11544	7.405,53	0,00
US36294WQS07	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.36	0,00	-90,18	5.020,14	116,84983	5.218,88	0,00
US36294XAA46	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.07.22	0,00	-1.417,86	4.966,11	102,10044	4.511,05	0,00
US36294XCP96	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.09.22	0,00	-591,17	2.984,05	100,93598	2.679,70	0,00
US36294XCV64	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.09.37	0,00	-1.921,84	19.775,50	121,12514	21.310,59	0,01
US36294YNUJ90	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.37	0,00	-75,41	4.384,70	109,26221	4.262,30	0,00
US36294YNU46	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.37	0,00	-710,73	1.096,90	113,36757	1.106,34	0,00
US36295AFF75	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.12.22	0,00	-1.189,25	2.149,61	100,39356	1.919,99	0,00
US36295CAW10	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.23	0,00	-1.811,98	12.204,41	102,56965	11.137,03	0,01
US36295DPB90	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.09.39	0,00	-4.956,03	11.481,59	108,24565	11.057,22	0,01
US36295E5D56	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.02.38	0,00	-390,17	2.701,80	117,15836	2.816,17	0,00
US36295F6K53	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.09.37	0,00	-43,82	3.039,28	113,84678	3.078,40	0,00
US36295FGG37	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.37	0,00	-1.780,41	4.921,34	118,63593	5.194,38	0,00
US36295FHS65	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.37	0,00	-14,83	859,65	106,11644	811,59	0,00
US36295HKX79	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.08.22	0,00	-1.545,08	5.100,19	101,53524	4.607,20	0,00
US36295HM319	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.37	0,00	-71,33	4.548,06	119,54128	4.837,02	0,00
US36295LUA78	6,000 GINNIE MAE I POOL 15.09.37	0,00	-2.536,79	167.791,23	118,71160	177.213,21	0,11
US36295MD714	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.08.24	0,00	-1.433,60	13.881,70	104,55355	12.912,64	0,01
US36295NKF32	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.05.38	0,00	-2.218,96	163.365,86	120,89054	175.706,29	0,11
US36295NNM55	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.06.38	0,00	-278,39	19.920,00	119,10505	21.108,31	0,01
US36295NV201	3,500 GINNIE MAE II POOL 20.07.47	0,00	-18.278,34	190.505,48	106,50307	180.510,84	0,12
US36295P4L38	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.05.23	0,00	-1.345,87	8.912,18	104,24902	8.265,89	0,01
US36295PMS82	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.23	0,00	-9.492,01	16.316,54	104,03394	15.102,08	0,01
US36295QA422	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.38	0,00	-10.369,69	46.338,38	116,95102	48.214,60	0,03
US36295QFM78	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.23	0,00	-2.519,86	7.934,66	102,88028	7.262,63	0,00
US36295QFZ81	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.38	0,00	-1.429,51	9.863,79	116,06522	10.185,44	0,01
US36295QGL86	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.38	0,00	-1.560,29	80.777,46	110,96223	79.744,19	0,05
US36295RP360	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.12.23	0,00	-2.993,21	16.217,61	103,62705	14.951,81	0,01
US36295STG11	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.37	0,00	-39,91	2.551,71	112,51906	2.554,41	0,00
US36295TSH85	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.38	0,00	-398,95	19.638,96	118,75201	20.748,81	0,01
US36295W3D76	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.02.23	0,00	-826,78	2.566,50	100,45081	2.293,66	0,00
US36295W4W49	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.23	0,00	-41,55	275,12	102,74426	251,49	0,00
US36296BB768	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.06.38	0,00	-955,97	58.007,70	113,91722	58.790,71	0,04
US36296BDB93	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.23	0,00	-251,25	1.523,84	106,18241	1.439,55	0,00
US36296DFZ69	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.09.23	0,00	-1.645,03	11.608,46	106,93744	11.044,30	0,01
US36296DND65	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.38	0,00	-21.140,06	126.647,17	122,91510	138.495,11	0,09
US36296E5H50	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.07.23	0,00	-7.405,52	17.873,44	104,03263	16.542,89	0,01
US36296FF992	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.23	0,00	-1.558,91	11.252,25	104,38517	10.449,89	0,01
US36296GR524	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.06.38	0,00	-1.187,19	12.493,95	116,36256	12.934,41	0,01
US36296HBH12	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.09.23	0,00	-2.605,82	19.354,85	103,98329	17.905,52	0,01
US36296HBJ77	6,000 GINNIE MAE I POOL 15.09.23	0,00	-1.201,60	3.202,17	105,32233	3.000,53	0,00
US36296KP637	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.38	0,00	-45,64	3.336,78	117,55746	3.489,88	0,00
US36296LUN80	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.08.23	0,00	-15.048,77	103.257,16	105,04153	96.497,24	0,06
US36296MQB71	6,000 GINNIE MAE I POOL 15.08.23	0,00	-629,81	4.148,97	104,99763	3.875,73	0,00
US36296P4A62	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.23	0,00	-1.061,87	6.400,19	102,32759	5.826,65	0,00
US36296P6S52	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.38	0,00	-3.507,10	30.454,00	114,49320	31.021,14	0,02
US36296PSG71	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.10.23	0,00	-11.773,45	15.533,63	105,96944	14.644,93	0,01
US36296Q2T53	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.39	0,00	-15.615,52	142.802,28	110,25150	140.072,65	0,09
US36296SRQ02	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.10.40	0,00	-238,58	14.217,67	108,19871	13.686,25	0,01
US36296TA457	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.02.39	0,00	-253,28	14.413,54	108,24570	13.880,82	0,01
US36296TQR76	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.38	0,00	-50.660,04	227.580,40	115,87674	234.619,88	0,15
US36296UWE62	5,000 GINNIE MAE II POOL 20.05.34	0,00	-3.855,64	119.862,08	107,42797	114.559,96	0,07
US36296WFX92	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.03.41	0,00	-3.103,89	11.893,07	108,33071	11.462,50	0,01
US36296WJG24	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.42	0,00	-514,65	49.244,43	110,62681	48.467,56	0,03
US36296WW364	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.04.39	0,00	-69,02	3.236,82	117,29722	3.377,85	0,00
US36296XJ625	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.39	0,00	-213,65	13.640,12	114,17458	13.855,47	0,01
US36296XY814	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.24	0,00	-2.722,49	22.155,57	104,52721	20.603,74	0,01
US36296XYV09	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.39	0,00	-1.202,50	16.942,31	110,25147	16.618,46	0,01
US36297A3K79	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.01.24	0,05	-603,72	5.218,33	102,82600	4.773,84	0,00
US36297AKC61	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.01.24	0,00	-7.160,04	46.700,64	104,99398	43.623,54	0,03
US36297B4P30	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.01.24	0,00	-16.044,28	126.302,60	105,62791	118.692,88	0,08
US36297BXY28	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.02.24	0,00	-737,46	6.013,06	104,91663	5.612,72	0,00
US36297CEX39	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.07.40	0,00	-234,72	11.649,34	108,19871	11.213,91	0,01
US36297CRL53	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.02.40	0,00	-341,79	22.235,64	108,19873	21.404,52	0,01
US36297CVT34	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.01.24	0,00	-364,74	3.006,55	101,18375	2.706,53	0,00
US36297FRG99	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.39	0,00	-34.527,73	347.361,85	110,25151	340.722,15	0,22
US36297FWP34	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.09.39	0,00	-191.236,12	1.481.480,43	118,38155	1.560.319,86	1,01
US36297JBM53	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.12.40	0,00	-245,63	13.311,26	108,19872	12.813,71	0,01
US36297JPG30	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.05.24	0,00	-982,32	2.462,90	105,77652	2.317,77	0,00
US36297KJ851	4,000 GINNIE MAE I POOL 15.07.39	0,00	-22.088,85	169.935,42	108,24572	163.654,64	0,11
US36297KXU05	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.07.24	0,00	-31.088,51	276.665,23	107,23281	263.946,53	0,17
US36297KXV87	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.07.24	0,00	-38.269,27	335.352,40	106,17325	316.774,51	0,20
US38373MLD01	0,014 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.03.44	0,00	-34.784,49	2.466.522,89	0,04535	995,07	0,00

US38373VHS25	1,909 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.08.32	0,09	-276,95	4,20	100,00000	3,73	0,00
US38373XGS99	1,859 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.06.32	0,08	-25.965,40	365,75	100,20328	326,05	0,00
US38373XZ824	1,859 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.07.32	0,10	-1.759,09	585,99	100,00000	521,34	0,00
US38374E7S09	0,086 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.01.44	0,00	-11.536,20	631.188,46	0,23020	1.292,69	0,00
US38374EJZ16	0,412 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.02.44	0,00	-11.338,65	502.352,41	0,89493	3.999,74	0,00
US38374U3W94	2,709 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.06.39	0,00	-91.209,60	1.340.454,30	102,82727	1.226.292,25	0,79
US38375B8G05	3,034 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 20.09.63	0,00	-47.578,23	689.303,61	101,81463	624.387,80	0,40
US38375BU834	2,734 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 20.04.63	0,00	-144.219,57	2.363.935,43	101,84091	2.141.862,35	1,38
US38375GCR02	0,767 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 20.04.40	0,00	-219.293,20	2.137.746,30	2,16764	41.226,45	0,03
US38376CRG68	2,509 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.09.39	0,00	-100.937,60	1.032.603,97	101,88710	936.023,38	0,60
US38376RHR03	2,484 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 20.09.65	0,00	-24.896,10	759.754,05	99,94699	675.579,47	0,44
US38376RVV58	2,534 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 20.06.66	11,94	-4.842,12	168.886,37	100,59864	151.154,27	0,10
US38378PS667	3,000 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 20.01.29	0,00	-47.841,25	348.550,22	7,22460	22.403,35	0,01
US38379VRN63	4,347 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 20.01.31	0,00	-143.896,05	860.274,54	106,08737	811.959,67	0,52
US38379X3G30	3,000 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 20.10.45	0,00	0,00	2.749.496,00	21,30360	521.122,31	0,34
US38381AA554	4,000 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 20.11.48	2.102.367,37	0,00	2.102.367,37	107,49403	2.010.604,38	1,30
US46629QAW69	1,837 JP MORGAN MORTGAGE ACQUISITION 25.10.36	0,00	-127.025,24	1.456.797,83	97,51769	1.263.910,69	0,81
US9020UAR68	2,087 MERRILL LYNCH MORTGAGE INVESTORS 25.04.29	0,05	-26.012,21	162.855,92	98,23441	142.331,44	0,09
US61911CAA18	1,770 MORTGAGE EQUITY CONVERSION ASSET 25.02.42	0,00	-24.913,89	410.429,86	96,93823	353.971,02	0,23
US61911GAA22	1,930 MORTGAGE EQUITY CONVERSION ASSET 25.05.42	0,00	-94.045,17	2.200.344,01	94,49304	1.849.797,10	1,19
US63940PAB13	3,190 NAVIENT PRIVATE EDUCATION REFI LOAN 18.02.42	2.600.000,00	0,00	2.600.000,00	102,27096	2.365.698,38	1,53
US71338AAA97	2,647 PEPPER RESIDENTIAL SECURITIES TRUST 20.06.60	0,00	-513.032,75	1.302.295,12	100,05544	1.159.267,92	0,75
US78442GNK84	2,394 SLM STUDENT LOAN TRUST 2004-10 25.10.29	0,00	0,00	500.000,00	99,91738	444.472,33	0,29
US78449KAB61	2,340 SMB PRIVATE EDUCATION LOAN TRUST 15.09.34	1.920.365,16	-47.387,86	1.872.977,30	100,39312	1.672.900,73	1,08
US83401AAB44	3,600 SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2018 25.02.48	2.000.000,00	0,00	2.000.000,00	106,16197	1.889.002,94	1,22
US939336X409	2,267 WAMU MORTGAGE PASS-THROUGH 25.01.45	0,00	-11.309,97	80.732,72	97,49299	70.025,56	0,05
Summe USD						132.268.212,78	85,28
Devisenmittelkurs:	1,124000						
Zerobonds							
Währung: USD							
US38376GCX60	0,000 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.11.51	0,00	-41.768,28	3.843.322,09	0,00100	34,19	0,00
US38376GGH74	0,000 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.01.52	0,00	-4.194,73	407.587,39	0,00391	14,16	0,00
Summe USD						48,35	0,00
Devisenmittelkurs:	1,124000						
nicht notierte Wertpapiere							
Anleihen							
Währung: USD							
US04002QAA04	2,630 AREIT 2018-CRE2 TRUST 14.11.35	0,00	-315.610,01	529.975,62	100,23926	472.636,68	0,30
US056059AA67	2,409 BX COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 2018 15.11.35	0,00	-739.997,20	1.696.373,85	99,43986	1.500.775,60	0,97
US12558MBB72	2,167 CIT HOME EQUITY LOAN TRUST 2002-2 25.06.33	0,00	-792,35	2.205,26	100,08729	1.963,68	0,00
US12647RAA23	4,789 CSMC 2013-MH1 TRUST 27.05.53	0,00	-2.757,31	369.214,28	114,10631	374.819,22	0,24
US16678RAS67	1,907 CHEVY CHASE FUNDING LLC MORTGAGE 25.01.35	0,00	-5.209,58	17.890,90	98,20177	15.630,94	0,01
US45660LCL18	2,267 INDYMAC INDX MORTGAGE LOAN TRUST 25.02.35	0,00	-8.272,59	91.476,29	97,75099	79.554,25	0,05
US75970NAA54	2,387 RENAISSANCE HOME EQUITY LOAN TRUST 25.12.32	0,00	0,00	21.372,20	96,30993	18.312,77	0,01
US94988HAK77	1,754 WELLS FARGO COMMERCIAL MORTGAGE 15.10.45	0,00	-75.991,36	845.811,51	3,64778	27.449,59	0,02
Summe USD						2.491.142,73	1,61
Devisenmittelkurs:	1,124000						
Neuemissionen							
Anleihen							
Währung: USD							
US3137FQLW10	1,255 FREDDIE MAC REMICS 25.01.50	923.917,00	-20.286,21	903.630,79	100,30997	806.433,99	0,52
US36179VDF40	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.01.50	520.400,00	-698,66	519.701,34	103,96104	480.682,33	0,31
US36179VFP04	3,000 GINNIE MAE II POOL 20.02.50	3.496.199,00	-1.000.000,00	2.496.199,00	102,29175	2.271.713,25	1,46
US3617MCRYH44	3,000 GINNIE MAE II POOL 20.01.50	1.704.155,00	-2.775,40	1.701.379,60	101,19774	1.531.812,88	0,99
Summe USD						5.090.642,45	3,28
Devisenmittelkurs:	1,124000						
Gesamtsumme Wertpapiere							
						141.512.952,01	91,24
Derivative Produkte							
Devisentermingeschäfte							
		Verkauf		Kauf		Kursdifferenz EUR	Anteil in %
		-1.527.000,00	GBP	1.827.989,43	EUR	108.022,95	0,07
		53.495.005,72	USD	48.898.363,92	EUR	1.346.486,89	0,87
		45.368.275,65	USD	41.184.469,00	EUR	856.467,62	0,55
		54.128.491,23	USD	49.019.440,09	EUR	904.455,82	0,58
		-8.078.740,21	USD	7.183.000,00	EUR	1.782,69	0,00
Summe Devisentermingeschäfte						3.217.215,97	2,07
Forwards							
		Nominale		Kaufkurs		Börsekurs	Gewinn/Verlust Anteil in %
Währung: USD							
US01F0204309	FNCI 2,0 18.03.20	700.000,00		99,59	100,36557	4.806,68	0,00
US01F0204309	FNCI 2,0 18.03.20	-700.000,00		101,74	100,36557	8.536,77	0,01
US01F0204481	FNCI 2,0 20.04.20	700.000,00		101,58	100,24264	-8.317,05	-0,01
US01F0224364	FNCI 2,5 18.03.20	400.000,00		101,49	101,89736	1.441,88	0,00
US01F0224364	FNCI 2,5 18.03.20	-400.000,00		102,86	101,89736	3.409,64	0,00
US01F0224448	FNCI 2,5 20.04.20	400.000,00		102,77	101,86333	-3.211,02	0,00
US01F0304398	FNCI 3,0 18.03.20	500.000,00		102,88	102,85563	-86,16	0,00

US01F0304398	FNCL 3,0 18.03.20	-500.000,00	103,70	102,85563	3.752,61	0,00
US01F0304471	FNCL 3,0 20.04.20	500.000,00	103,60	102,84936	-3.328,70	0,00
US01F0306526	FNCL 3,0 13.05.20	1.000.000,00	101,74	101,57422	-1.494,38	0,00
US01F0326417	FNCL 3,5 15.04.20	6.800.000,00	103,92	102,78232	-68.941,16	-0,04
US01F0406441	FNCL 4,0 15.04.20	-1.900.000,00	105,73	104,74438	16.668,79	0,01
US01F0426407	FNCL 4,5 15.04.20	-900.000,00	106,80	106,30273	3.956,63	0,00
US01N0306389	GNSF 3,0 23.03.20	1.500.000,00	102,63	101,94793	-9.139,91	-0,01
US01N0306389	GNSF 3,0 23.03.20	3.500.000,00	102,50	101,94793	-17.190,85	-0,01
US01N0306389	GNSF 3,0 23.03.20	-5.000.000,00	103,76	101,94793	80.510,85	0,05
US01N0306462	GNSF 3,0 21.04.20	5.000.000,00	103,66	101,84416	-80.608,94	-0,05
US01N0326346	GNSF 3,5 23.03.20	600.000,00	104,21	103,21293	-5.327,45	0,00
US01N0326346	GNSF 3,5 23.03.20	-600.000,00	104,56	103,21293	7.204,11	0,00
US01N0326429	GNSF 3,5 21.04.20	600.000,00	104,53	103,14408	-7.404,84	0,00
US01N0526325	GNSF 5,5 23.03.20	-1.000.000,00	107,16	106,26565	7.923,48	0,01
US01N0526325	GNSF 5,5 23.03.20	1.000.000,00	108,48	106,26565	-19.670,03	-0,01
US01N0526408	GNSF 5,5 21.04.20	-1.000.000,00	108,42	106,23440	19.461,52	0,01
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	10.850.000,00	102,46	102,11275	-33.987,33	-0,02
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	1.000.000,00	102,68	102,11275	-5.078,64	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-1.000.000,00	102,63	102,11275	4.557,35	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	1.000.000,00	102,68	102,11275	-5.078,64	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-1.500.000,00	102,63	102,11275	6.836,03	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-500.000,00	102,63	102,11275	2.278,67	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	200.000,00	102,64	102,11275	-946,21	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-500.000,00	102,61	102,11275	2.209,17	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	1.500.000,00	102,64	102,11275	-7.096,68	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	200.000,00	102,64	102,11275	-946,21	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	300.000,00	102,64	102,11275	-1.419,33	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-200.000,00	102,65	102,11275	953,16	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-300.000,00	102,65	102,11275	1.429,75	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-1.000.000,00	102,52	102,11275	3.653,77	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-1.000.000,00	102,52	102,11275	3.653,77	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-5.000.000,00	102,48	102,11275	16.531,22	0,01
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-1.000.000,00	102,50	102,11275	3.445,25	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-1.000.000,00	102,49	102,11275	3.375,74	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-1.000.000,00	102,48	102,11275	3.236,73	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-1.000.000,00	102,49	102,11275	3.375,74	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-3.650.000,00	102,39	102,11275	9.086,84	0,01
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-1.000.000,00	102,39	102,11275	2.489,54	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-1.500.000,00	102,39	102,11275	3.734,31	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-200.000,00	102,39	102,11275	497,90	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-300.000,00	102,52	102,11275	1.096,12	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-700.000,00	102,52	102,11275	2.557,63	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	300.000,00	102,44	102,11275	-866,76	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	200.000,00	102,53	102,11275	-744,65	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	500.000,00	102,55	102,11275	-1.931,14	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	500.000,00	102,52	102,11275	-1.826,88	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	5.800.000,00	102,66	102,11275	-28.045,21	-0,02
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	1.000.000,00	102,66	102,11275	-4.835,38	0,00
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-1.000.000,00	103,41	102,11275	11.577,48	0,01
US21H0306330	G2SF 3,0 23.03.20	-2.500.000,00	102,16	102,11275	1.141,20	0,00
US21H0306413	G2SF 3,0 21.04.20	6.350.000,00	102,31	101,87212	-24.879,17	-0,02
US21H0306413	G2SF 3,0 21.04.20	1.000.000,00	103,30	101,87212	-12.675,76	-0,01
US21H0306413	G2SF 3,0 21.04.20	1.000.000,00	102,06	101,87212	-1.693,78	0,00
US21H0306413	G2SF 3,0 21.04.20	1.000.000,00	102,02	101,87212	-1.276,74	0,00
US21H0306413	G2SF 3,0 21.04.20	2.000.000,00	102,07	101,87212	-3.596,06	0,00
US21H0306413	G2SF 3,0 21.04.20	2.500.000,00	101,88	101,87212	-237,82	0,00
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	1.000.000,00	103,17	102,23434	-8.306,33	-0,01
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	1.000.000,00	103,14	102,23434	-8.063,06	-0,01
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	1.000.000,00	103,13	102,23434	-7.958,80	-0,01
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	1.000.000,00	102,94	102,23434	-6.255,90	0,00
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	1.000.000,00	103,00	102,23434	-6.777,19	0,00
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	1.000.000,00	102,87	102,23434	-5.630,34	0,00
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	-1.000.000,00	102,99	102,23434	6.707,69	0,00
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	1.000.000,00	102,97	102,23434	-6.533,93	0,00
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	-1.000.000,00	102,99	102,23434	6.707,69	0,00
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	-1.000.000,00	102,92	102,23434	6.116,89	0,00
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	2.800.000,00	103,05	102,23434	-20.241,18	-0,01
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	-4.200.000,00	102,90	102,23434	24.961,11	0,02
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	4.200.000,00	103,05	102,23434	-30.361,77	-0,02
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	-1.000.000,00	103,18	102,23434	8.410,59	0,01
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	2.500.000,00	103,18	102,23434	-20.939,60	-0,01
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	-100.000,00	102,98	102,23434	667,28	0,00
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	100.000,00	103,16	102,23434	-820,20	0,00
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	-6.700.000,00	102,98	102,23434	44.708,72	0,03
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	1.000.000,00	103,16	102,23434	-8.202,08	-0,01
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	700.000,00	103,23	102,23434	-6.227,99	0,00
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	-300.000,00	103,12	102,23434	2.356,36	0,00
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	300.000,00	103,23	102,23434	-2.669,13	0,00
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	1.000.000,00	103,23	102,23434	-8.897,14	-0,01
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	6.000.000,00	103,23	102,23434	-53.382,86	-0,03
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	-6.800.000,00	103,19	102,23434	57.901,03	0,04
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	-2.500.000,00	103,19	102,23434	21.287,14	0,01
US21H0326395	G2SF 3,5 23.03.20	-1.000.000,00	103,19	102,23434	8.514,85	0,01
US21H0326478	G2SF 3,5 21.04.20	4.200.000,00	102,92	102,21237	-26.511,82	-0,02
US21H0326478	G2SF 3,5 21.04.20	300.000,00	103,11	102,21237	-2.404,56	0,00
US21H0326478	G2SF 3,5 21.04.20	10.300.000,00	103,16	102,21237	-87.210,39	-0,06

US21H0326478	G2SF 3,5 21.04.20	-14.800.000,00	103,83	102,21237	213.265,23	0,14
US21H0326544	G2SF 3,5 20.05.20	14.800.000,00	103,80	102,21457	-208.346,86	-0,13
US21H0406320	G2SF 4,0 23.03.20	5.040.000,00	103,82	103,51175	-13.835,73	-0,01
US21H0406320	G2SF 4,0 23.03.20	2.000.000,00	103,73	103,51175	-3.961,24	0,00
US21H0406320	G2SF 4,0 23.03.20	1.300.000,00	103,83	103,51175	-3.659,10	0,00
US21H0406320	G2SF 4,0 23.03.20	-7.040.000,00	104,20	103,51175	42.813,65	0,03
US21H0406320	G2SF 4,0 23.03.20	-1.300.000,00	104,20	103,51175	7.905,92	0,01
US21H0406403	G2SF 4,0 21.04.20	8.340.000,00	104,31	103,72227	-43.794,78	-0,03
US21H0426385	G2SF 4,5 23.03.20	500.000,00	105,17	104,81399	-1.592,01	0,00
US21H0426385	G2SF 4,5 23.03.20	-500.000,00	105,48	104,81399	2.982,14	0,00
US21H0426468	G2SF 4,5 21.04.20	500.000,00	105,56	104,96880	-2.640,99	0,00
	Summe USD				-256.411,24	-0,17
	Devisenmittelkurs:	1,124000				
	Summe Forwards				-256.411,24	-0,17
	Gesamtsumme Derivative Produkte				2.960.804,73	1,91

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

Währung: USD			
US3128MMYA58	2,500 FREDDIE MAC GOLD POOL 01.06.33	0,00	-436.022,02
US3131YBJM16	3,500 FREDDIE MAC POOL 01.04.49	1.310.169,38	-1.310.169,38
US31329QZL84	3,500 FREDDIE MAC POOL 01.05.49	3.752.019,17	-3.752.019,17
US3132AD6M55	3,500 FREDDIE MAC POOL 01.03.49	328.285,75	-328.285,75
US3132AECC84	3,000 FREDDIE MAC POOL 01.04.49	878.550,26	-878.550,26
US3132AEKB10	3,000 FREDDIE MAC POOL 01.06.49	399.999,82	-399.999,82
US3132D53T70	2,500 FREDDIE MAC POOL 01.10.34	399.999,56	-399.999,56
US3132DV3M54	3,000 FREDDIE MAC POOL 01.08.49	5.921.451,61	-5.921.451,61
US3132DV3Z67	3,000 FREDDIE MAC POOL 01.10.49	399.999,64	-399.999,64
US3132DV4J17	3,500 FREDDIE MAC POOL 01.11.49	860.229,17	-860.229,17
US3132DV5S07	3,500 FREDDIE MAC POOL 01.04.50	548.619,00	-548.619,00
US31339UFS42	3,000 FREDDIE MAC POOL 01.10.49	400.000,00	-400.000,00
US3137B1B277	1,252 FREDDIE MAC MULTIFAMILY STRUCTURED 25.11.19	0,00	-599.663,15
US3138AXXQ92	3,000 FANNIE MAE POOL 01.12.26	499.999,96	-499.999,96
US3138EJRG54	3,000 FANNIE MAE POOL 01.09.27	499.999,97	-499.999,97
US3138WJKT47	2,000 FANNIE MAE POOL 01.11.31	0,00	-777.021,57
US31398VJA52	0,475 FREDDIE MAC MULTIFAMILY STRUCTURED 25.01.20	0,00	-2.956.937,85
US3140JHH635	4,500 FANNIE MAE POOL 01.11.48	0,00	-456.638,63
US3140JPKH79	3,500 FANNIE MAE POOL 01.05.49	1.999.801,08	-1.999.801,08
US3140JRG701	4,500 FANNIE MAE POOL 01.08.49	1.349.999,94	-1.349.999,94
US3140JRW2P4	4,500 FANNIE MAE POOL 01.04.49	450.000,23	-450.000,23
US3140Q9F659	4,500 FANNIE MAE POOL 01.07.48	0,00	-915.186,60
US3140QBB982	3,500 FANNIE MAE POOL 01.06.49	347.558,44	-347.558,44
US3140X4LU88	4,000 FANNIE MAE POOL 01.03.49	1.899.998,71	-1.899.998,71
US3140X5BH52	3,000 FANNIE MAE POOL 01.07.28	499.950,00	-499.950,00
US31418DBG60	4,000 FANNIE MAE POOL 01.04.49	1.899.811,30	-1.899.811,30
US31418DBH44	4,500 FANNIE MAE POOL 01.04.49	1.049.999,80	-1.049.999,80
US31418DC593	3,000 FANNIE MAE POOL 01.07.49	1.199.899,38	-1.199.899,38
US31418DC676	3,500 FANNIE MAE POOL 01.07.49	1.852.293,04	-1.852.293,04
US31418DC833	4,500 FANNIE MAE POOL 01.07.49	899.910,30	-899.910,30
US31418DCA81	4,000 FANNIE MAE POOL 01.05.49	1.900.189,13	-1.900.189,13
US31418DCT72	3,000 FANNIE MAE POOL 01.06.34	500.000,43	-500.000,43
US31418DCY67	3,500 FANNIE MAE POOL 01.06.49	499.999,81	-499.999,81
US31418DCZ33	4,000 FANNIE MAE POOL 01.06.49	100.000,18	-100.000,18
US31418DEK46	2,500 FANNIE MAE POOL 01.08.34	399.999,68	-399.999,68
US31418DET54	3,500 FANNIE MAE POOL 01.08.49	499.999,13	-499.999,13
US31418DFQ07	3,000 FANNIE MAE POOL 01.09.49	2.200.000,26	-2.200.000,26
US31418DMU36	2,000 FANNIE MAE POOL 01.03.35	700.000,00	-700.000,00
US36179U4D18	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.10.49	1.994.981,08	-1.994.981,08
US36179UQ624	4,500 GINNIE MAE II POOL 20.04.49	0,00	-491.844,70
US36179UV905	4,000 GINNIE MAE II POOL 20.07.49	0,01	-1.496.673,75
US36179VBE92	2,500 GINNIE MAE II POOL 20.12.49	3.000.299,93	-3.000.299,93
US36179VBG41	3,500 GINNIE MAE II POOL 20.12.49	10.098.689,04	-10.098.689,04
US36201LHV99	5,000 GINNIE MAE I POOL 15.10.19	0,00	-0,02
US36202EB653	6,000 GINNIE MAE II POOL 20.12.19	0,00	-67,12
US3620C3LA88	4,740 GINNIE MAE II POOL 20.07.40	0,00	-94.530,65
US36241KAJ79	4,500 GINNIE MAE I POOL 15.10.19	0,00	-0,02
US36292D4D15	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.05.36	0,00	-5.006,38
US36294WQN10	5,500 GINNIE MAE I POOL 15.12.21	0,00	-3.310,09
US36296LST88	6,500 GINNIE MAE I POOL 15.11.38	0,00	-17.520,09
US38373TTB16	2,170 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.11.27	0,08	-79.276,68
US38373V5Q90	2,063 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 16.12.26	0,02	-89.079,39
US38373XMC73	2,522 GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE 20.06.32	0,00	-29.385,87
US9127962A61	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 07.04.20	800.000,00	-800.000,00
US912796RN16	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 05.12.19	0,00	-500.000,00
US912796SD25	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 27.02.20	600.000,00	-600.000,00
US912796SX88	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 19.12.19	900.000,00	-900.000,00
US912796TE98	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 06.02.20	900.000,00	-900.000,00
US912796TF63	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 13.02.20	1.200.000,00	-1.200.000,00
US912796TH20	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 05.03.20	1.600.000,00	-1.600.000,00
US912796TL32	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 19.03.20	6.900.000,00	-6.900.000,00
US912796TM15	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 02.04.20	500.000,00	-500.000,00
US912796TQ29	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 09.04.20	3.500.000,00	-3.500.000,00
US912796TT67	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 07.05.20	500.000,00	-500.000,00
US912796UB31	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 02.07.20	500.000,00	-500.000,00

US912796VY25	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 08.10.19	600.000,00	-600.000,00
US912796WD78	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 12.11.19	600.000,00	-600.000,00
US912796WG00	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 03.12.19	2.000.000,00	-2.000.000,00
US912796WH82	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 10.12.19	600.000,00	-600.000,00
US912796WJ49	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 17.12.19	3.800.000,00	-3.800.000,00
US912796WN50	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 14.01.20	2.000.000,00	-2.000.000,00
US912796WQ81	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 28.01.20	700.000,00	-700.000,00
US912796XD69	0,000 UNITED STATES TREASURY BILL 31.03.20	1.900.000,00	-1.900.000,00