

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND CORP. EUR RESPONSIBLE

Jahresbericht per 28.02.2023

Teilvermögen des Swisscanto (CH) Index Fund V
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

Klasse	Valor	Währung
DT EUR	11705240	EUR
FA EUR	31562115	EUR
NT EUR	11705239	EUR
NTH1 CHF	59570850	CHF

Rechnungswährung: EUR

Weitere Informationen stehen im Internet unter www.swisscanto-fondsleitungen.com zur Verfügung.

Zürich, 28. Juni 2023

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

An den Verwaltungsrat der Fondsleitung zu den Jahresrechnungen des

Swisscanto (CH) Index Fund V, Zürich

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund V,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Domestic CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Foreign CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund USA Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible¹
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World ex EUR/USD
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible

¹ Erfolgsrechnung für den Zeitraum vom 25. Februar 2022 bis 28. Februar 2023 für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible.

- ▶ Swissscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency
- ▶ Swissscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect
- ▶ Swissscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect
- ▶ Swissscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect
- ▶ Swissscanto (CH) Index Commodity Fund

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 28. Februar 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr¹, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entsprechen die beigefügten Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen“ unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Anlagefonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist verantwortlich für die Aufstellung der Jahresrechnungen in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen, dem Fondsvertrag sowie dem Prospekt und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat als notwendig feststellt, um die Aufstellung von Jahresrechnungen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind.



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnungen als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnungen getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

¹ Erfolgsrechnung für den Zeitraum vom 25. Februar 2022 bis 28. Februar 2023 für das Teilvermögen Swissscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible.

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemässes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- ▶ identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in den Jahresrechnungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeits, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- ▶ gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten Internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des Internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.
- ▶ beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

Wir kommunizieren mit dem Verwaltungsrat der Fondsleitung unter anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschliesslich etwaiger bedeutsamer Mängel im Internen Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung identifizieren.

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 28. Februar 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	3
2	Vertriebsorganisation	4
3	Abschlusszahlen	5
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	60
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	61
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	61
7	Pauschale Verwaltungskommission	62
8	Benchmark	62
9	TER	62
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	63
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	63
12	Fussnoten	63
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte Pflichtpublikationen	64 66

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

Daniel Previdoli, Präsident
Mitglied der Generaldirektion und Leiter Products,
Services & Direct Banking, Zürcher Kantonalbank

Christoph Schenk, Vizepräsident
Mitglied der Direktion und Leiter Investment Solutions,
Zürcher Kantonalbank

Dr. Thomas Fischer, Mitglied (ab 03.01.2023)
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

Regina Kleeb, Mitglied
Unabhängige Verwaltungsrätin, Master of Advanced Studies in Bankmanagement (IFZ)

Geschäftsleitung

Hans Frey
Geschäftsführer
Andreas Hogg
Stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services
Silvia Karrer
Leiterin Administration & Operations

Delegationen

Anlageentscheide Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich
Fondsadministration Swisscanto Fondsleitung AG, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.03.2022	01.03.2021	01.03.2020	01.03.2019
	bis	28.02.2023	28.02.2022	28.02.2021	29.02.2020
Konsolidiert					
EUR					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		580'670'726.23	592'592'965.27	740'274'467.05	696'249'711.05
Klasse DT EUR					
EUR					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode					685'783.56
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode					5'350.001
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)					128.1838
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF					136.2913
Thesaurierung je Anteil					2.04
Total Expense Ratio (TER)					0.20 %
Klasse FA EUR					
EUR					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'799'875.18	1'018'384.31	994'542.46	362'569.01
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		21'703.023	10'968.696	10'123.696	3'667.771
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		82.9320	92.8446	98.2391	98.8527
Ausschüttung je Anteil		1.25	1.20	1.40	1.60
Total Expense Ratio (TER)		0.20 %	0.20 %	0.20 %	0.25 %
Klasse NT EUR					
EUR					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		555'957'328.51	568'301'617.33	717'074'499.11	695'201'358.48
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'928'974.378	4'546'978.436	5'480'048.997	5'344'691.327
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		112.7937	124.9845	130.8518	130.0732
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		112.1119	128.7945	143.7868	138.3003
Thesaurierung je Anteil		1.83	1.96	2.14	2.32
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NTH1 CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in EUR)		22'913'522.54	23'272'963.63	22'205'425.48	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		267'304.701	252'318.701	246'025.678	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		85.2024	95.0481	99.1786	
Thesaurierung je Anteil (in EUR)		1.40	1.38	0.11	
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	

Die in diesem Bericht enthaltenen Zahlen und Angaben sind vergangenheitsbezogen. Diese dürfen nicht als Garantie für die zukünftige Entwicklung verstanden werden.

Performance

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse DT EUR (Schliessung 20.07.2020)	-	-	-	-0.10 %
Klasse FA EUR	-9.39 %	-13.78 %	-1.19 %	2.75 %
Klasse NT EUR	-9.20 %	-13.61 %	-0.99 %	2.95 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 29.01.2021)	-9.84 %	-14.05 %	-1.10 %	-
Benchmark Hedge	-10.17 %	-	-	-
Benchmark	-9.55 %	-14.09 %	-0.96 %	2.82 %
Tracking Error 33)	0.28 %	0.29 %	0.05 %	0.30 %

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kosten und Kommissionen unberücksichtigt.

Tracking Differenz

Klasse

Klasse FA EUR	0.16 %
Klasse NT EUR	0.35 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 29.01.2021)	0.33 %

Die Tracking Differenz ist insbesondere auf die Fondskosten (siehe Total Expense Ratio) und sofern anwendbar auf nicht rückforderbare Quellensteuern sowie auf Erträge aus Effektenleihe zurückzuführen. Der Portfoliomanager des Teilvermögens strebt an, den Index so genau wie möglich und zweckmässig nachzubilden um die verbleibende Tracking Differenz so tief wie möglich zu halten. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichenden Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	28.02.2023	28.02.2022
Bankguthaben auf Sicht	2'429'376.95	4'527'466.74
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	572'854'495.64	583'317'413.54
Derivative Finanzinstrumente	0.00	37.31
Sonstige Vermögenswerte	5'387'123.86	4'748'204.81
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	580'670'996.45	592'593'122.40
Andere Verbindlichkeiten	-270.22	-157.13
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	580'670'726.23	592'592'965.27

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse FA EUR	von bis	Lancierung	01.03.2021
		01.03.2022	28.02.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		10'968.696	10'123.696
Ausgegebene Anteile		17'425.000	845.000
Zurückgenommene Anteile		-6'690.673	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		21'703.023	10'968.696

Klasse NT EUR	von bis	01.03.2022	01.03.2021
		28.02.2023	28.02.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'546'978.436	5'480'048.997
Ausgegebene Anteile		1'215'530.746	1'255'248.296
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		242'851.509	-
Zurückgenommene Anteile		-783'026.514	-1'597'441.857
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-293'359.799	-590'877.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		4'928'974.378	4'546'978.436

Klasse NTH1 CHF	von bis	01.03.2022	01.03.2021
		28.02.2023	28.02.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		252'318.701	246'025.678
Ausgegebene Anteile		14'986.000	6'293.023
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		267'304.701	252'318.701

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT EUR	09.03.2022	1'265'347.82	10'186.616
Klasse NT EUR	12.07.2022	7'198'362.13	61'732.030
Klasse NT EUR	12.07.2022	2'215'063.29	18'996.037
Klasse NT EUR	09.12.2022	2'787'603.84	24'379.612
Klasse NT EUR	09.12.2022	11'884'618.80	103'939.588
Klasse NT EUR	25.01.2023	2'706'102.86	23'617.626

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT EUR	16.06.2022	2'688'753.93	23'694.681
Klasse NT EUR	16.06.2022	10'564'299.98	93'098.039
Klasse NT EUR	16.12.2022	4'325'683.56	38'227.780
Klasse NT EUR	16.12.2022	15'653'852.55	138'339.299

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		592'592'965.27	740'274'467.05
Ausbezahlte Ausschüttung		-23'926.44	-15'090.17
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-3'466'966.88	-4'038'191.67
Saldo aus dem Anteilverkehr		50'606'046.26	-120'183'795.17
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-59'037'391.98	-23'444'424.77
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		580'670'726.23	592'592'965.27

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		0.00	0.28
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-8'963.02	-18'169.38
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		9'444'102.38	10'406'887.48
Sonstige Erträge		0.00	-1.42
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'124'597.41	1'602'613.21
Total Ertrag		10'559'736.77	11'991'330.17
Aufwand			
Passivzinsen		-0.92	-3.33
Reglementarische Vergütungen		-3'315.56	-2'115.82
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'088'132.95	-2'681'105.00
Total Aufwand		-1'091'449.43	-2'683'224.15
Nettoertrag / Verlust		9'468'287.34	9'308'106.02
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-11'955'148.16	2'855'784.12
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		594'537.77	291'004.05
Realisierter Erfolg		-1'892'323.05	12'454'894.19
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-57'145'068.93	-35'899'318.96
Gesamterfolg		-59'037'391.98	-23'444'424.77

Verwendung des Erfolges

Klasse FA EUR	28.02.2023	28.02.2022
Nettoertrag	26'789.72	13'963.61
Vortrag des Vorjahres	1'066.89	265.72
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	27'856.61	14'229.33
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	27'128.78	13'162.44
Vortrag auf neue Rechnung	727.83	1'066.89
Total	27'856.61	14'229.33

Klasse NT EUR	28.02.2023	28.02.2022
Nettoertrag	9'067'053.95	8'943'943.86
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	9'067'053.95	8'943'943.86
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	3'173'468.88	3'130'380.35
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	5'893'585.07	5'813'563.51
Total	9'067'053.95	8'943'943.86

Klasse NTH1 CHF	28.02.2023	28.02.2022
Nettoertrag	374'443.67	350'198.55
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	374'443.67	350'198.55
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	131'055.28	122'569.49
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	243'388.39	227'629.06
Total	374'443.67	350'198.55

Inventar des Fondsvermögens am Ende der Rechnungsperiode und Bestandesveränderungen während der Periode

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							572'854'495.64	98.65	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							572'854'495.64	98.65	
AT0000A2GH08	0.8750 % ERSTBK 0 7/8 05/13/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.88%	175'762.00	0.03	a)
AT0000A2J645	1.6250 % ERSTBK 1 5/8 09/08/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	88.13%	88'125.00	0.02	a)
AT0000A2JAF6	0.0500 % ERSTBK 0.05 09/16/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.76%	181'512.00	0.03	a)
AT0000A2KW37	0.1000 % ERSTBK 0.1 11/16/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	82.84%	165'674.00	0.03	a)
AT0000A2N837	0.2500 % ERSTBK 0 1/4 01/27/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	75.06%	150'122.00	0.03	a)
AT0000A2RAA0	0.1250 % ERSTBK 0 1/8 05/17/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	81.26%	81'258.00	0.01	a)
AT0000A2STV4	0.5000 % CESSPO 0 1/2 09/13/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.36%	160'728.00	0.03	a)
AT0000A2SUH1	0.2500 % ERSTBK 0 1/4 09/14/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.29%	156'588.00	0.03	a)
AT0000A2U543	0.8750 % ERSTBK 0 7/8 11/15/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	81.13%	81'125.00	0.01	a)
AT0000A2YA29	4.0000 % ERSTBK 4 06/07/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.51%	185'010.00	0.03	a)
AT000B122080	0.8750 % VOWIBA 0 7/8 03/23/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.10%	178'208.00	0.03	a)
BE0002237064	1.8750 % PROXBB 1 7/8 10/01/25 EMTN	100	100	0	200 EUR	95.18%	190'354.00	0.03	a)
BE0002239086	1.3750 % ELIATB 1 3/8 05/27/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0002251206	3.1250 % CCBBGB 3 1/8 05/11/26	300	0	0	300 EUR	94.73%	284'196.00	0.05	a)
BE0002266352	0.7500 % KBCBB 0 3/4 10/18/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0002290592	1.6250 % KBCBB 1 5/8 09/18/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.50%	189'000.00	0.03	a)
BE0002432079	3.2500 % ELIATB 3 1/4 04/04/28 EMTN	200	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0002443183	2.8750 % FLUVIU 2 7/8 10/09/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0002470459	2.8750 % FLUVIU 2 7/8 05/07/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.73%	189'464.00	0.03	a)
BE0002597756	2.7500 % ELIASO 2 3/4 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0002601798	1.2500 % BPOST 1 1/4 07/11/26	200	0	0	200 EUR	91.68%	183'362.00	0.03	a)
BE0002631126	1.1250 % KBCBB 1 1/8 01/25/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0002644251	3.2500 % AGSBB 3 1/4 07/02/49	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0002645266	0.6250 % KBCBB 0 5/8 04/10/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.90%	187'808.00	0.03	a)
BE0002664457	0.5000 % KBCBB 0 1/2 12/03/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.75%	183'500.00	0.03	a)
BE0002681626	0.7500 % KBCBB 0 3/4 01/24/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	79.62%	159'244.00	0.03	a)
BE0002728096	0.1250 % KBCBB 0 1/8 09/10/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	90.25%	270'750.00	0.05	a)
BE0002755362	0.2500 % FLUVIU 0 1/4 12/02/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	76.31%	152'614.00	0.03	a)
BE0002766476	0.1250 % KBCBB 0 1/8 01/14/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	81.50%	244'500.00	0.04	a)
BE0002799808	0.7500 % KBCBB 0 3/4 05/31/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	76.67%	76'673.00	0.01	a)
BE0002803840	0.2500 % FLUVIU 0 1/4 06/14/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	82.94%	82'938.00	0.01	a)
BE0002819002	0.6250 % KBCBB 0 5/8 12/07/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	84.75%	169'500.00	0.03	a)
BE0002830116	0.7500 % PROXBB 0 3/4 11/17/36 EMTN	200	0	0	200 EUR	66.92%	133'846.00	0.02	a)
BE0002831122	0.6250 % FLUVIU 0 5/8 11/24/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	76.11%	152'224.00	0.03	a)
BE0002832138	0.2500 % KBCBB 0 1/4 03/01/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	88.75%	177'500.00	0.03	a)
BE0002839208	0.7500 % KBCBB 0 3/4 01/21/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.13%	174'250.00	0.03	a)
BE0002846278	1.5000 % KBCBB 1 1/2 03/29/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	94.38%	188'750.00	0.03	a)
BE0002871524	4.0000 % FLUVIU 4 07/06/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.97%	199'938.00	0.03	a)
BE0002875566	3.0000 % KBCBB 3 08/25/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.49%	184'976.00	0.03	a)
BE0002900810	4.3750 % KBCBB 4 3/8 11/23/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.00%	300'000.00	0.05	a)
BE0974365976	0.3750 % KBCBB 0 3/8 06/16/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	88.50%	88'500.00	0.02	a)
BE6243179650	2.8750 % ABIBB 2 7/8 09/25/24 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.52%	99'519.00	0.02	a)
BE6248644013	3.2500 % ABIBB 3 1/4 01/24/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.02%	95'024.00	0.02	a)
BE6265142099	2.7000 % ABIBB 2.7 03/31/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	97.21%	388'824.00	0.07	a)
BE6265262327	2.3750 % PROXBB 2 3/8 04/04/24 EMTN	100	0	0	100 EUR	98.32%	98'320.00	0.02	a)
BE6276040431	1.5000 % ABIBB 1 1/2 04/18/30 EMTN	450	0	0	450 EUR	86.81%	390'622.50	0.07	a)
BE6282460615	2.7500 % SOLBBB 2 3/4 12/02/27	200	0	0	200 EUR	95.52%	191'034.00	0.03	a)
BE6285455497	2.0000 % ABIBB 2 03/17/28 EMTN	780	0	0	780 EUR	92.39%	720'610.80	0.12	a)
BE6285457519	2.7500 % ABIBB 2 3/4 03/17/36 EMTN	491	300	0	791 EUR	86.74%	686'105.49	0.12	a)
BE6301510028	1.1500 % ABIBB 1.15 01/22/27 EMTN	500	0	0	500 EUR	90.90%	454'475.00	0.08	a)
BE6301511034	2.0000 % ABIBB 2 01/23/35 EMTN	250	0	0	250 EUR	80.87%	202'167.50	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
BE6305977074	0.5000 % EUROCL 0 1/2 07/10/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6307427029	0.6250 % CCBGBB 0 5/8 08/30/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6311694010	1.0000 % ARGSPA 1 02/06/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.03%	194'058.00	0.03	a)
BE6312821612	1.1250 % ABIBB 1 1/8 07/01/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	90.03%	360'120.00	0.06	a)
BE6312822628	1.6500 % ABIBB 1.65 03/28/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	85.51%	171'012.00	0.03	a)
BE6315719490	0.0000 % CCBGBB 0 08/28/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.71%	175'422.00	0.03	a)
BE6318702253	1.0000 % ARGSPA 1 01/29/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.92%	175'848.00	0.03	a)
BE6320934266	2.1250 % ABIBB 2 1/8 12/02/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.14%	279'432.00	0.05	a)
BE6320935271	2.8750 % ABIBB 2 7/8 04/02/32 EMTN	600	0	100	500 EUR	92.49%	462'465.00	0.08	a)
BE6320936287	3.7000 % ABIBB 3.7 04/02/40 EMTN	500	0	0	500 EUR	92.32%	461'575.00	0.08	a)
BE6321076711	1.6250 % LONNVX 1 5/8 04/21/27	200	0	0	200 EUR	91.40%	182'806.00	0.03	a)
BE6321529396	0.8750 % ELIATB 0 7/8 04/28/30 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6322991462	0.1250 % EUROCL 0 1/8 07/07/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.10%	184'202.00	0.03	a)
BE6324012978	0.3750 % CCBGBB 0 3/8 09/02/25	200	0	0	200 EUR	91.47%	182'946.00	0.03	a)
BE6324720299	0.0100 % CCBGBB 0.01 10/15/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.77%	181'546.00	0.03	a)
BE6325355822	1.8750 % AGSBB 1 7/8 11/24/51	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6325493268	0.8750 % COFBBB 0 7/8 12/02/30	200	0	0	200 EUR	74.08%	148'166.00	0.03	a)
BE6326784566	0.1250 % CCBGBB 0 1/8 02/08/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	83.87%	167'748.00	0.03	a)
BE6328785207	0.3750 % CCBGBB 0 3/8 06/08/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.54%	86'542.00	0.01	a)
BE6330288687	0.7500 % AEDBB 0 3/4 09/09/31	200	200	200	200 EUR	67.30%	134'594.00	0.02	a)
BE6331190973	1.2500 % CCBGBB 1 1/4 04/06/34 EMTN	0	100	0	100 EUR	78.25%	78'250.00	0.01	a)
BE6331562817	0.8750 % ALVPP 0 7/8 11/08/28	300	0	0	300 EUR	78.80%	236'400.00	0.04	a)
BE6333133039	1.3750 % ARGSPA 1 3/8 02/08/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	85.00%	170'000.00	0.03	a)
BE6334365713	1.1250 % ECLER 1 1/8 12/07/26	0	300	0	300 EUR	91.05%	273'153.00	0.05	a)
CH0314209351	2.1250 % UBS 2 1/8 03/04/24	400	0	200	200 EUR	98.52%	197'044.00	0.03	a)
CH0336602930	1.2500 % UBS 1 1/4 09/01/26 EMTN	600	0	0	600 EUR	91.06%	546'330.00	0.09	a)
CH0341440334	1.5000 % UBS 1 1/2 11/30/24	550	0	0	550 EUR	96.85%	532'664.00	0.09	a)
CH0343366842	1.2500 % CS 1 1/4 07/17/25 EMTN	550	550	550	550 EUR	91.63%	503'954.00	0.09	a)
CH0409606354	1.2500 % UBS 1 1/4 04/17/25	300	200	0	500 EUR	96.75%	483'750.00	0.08	a)
CH0483180946	1.0000 % CS 1 06/24/27 EMTN	300	450	400	350 EUR	80.54%	281'900.50	0.05	a)
CH0494734418	0.6500 % CS 0.65 09/10/29 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH0517825276	0.6500 % CS 0.65 01/14/28 EMTN	300	300	400	200 EUR	76.71%	153'418.00	0.03	a)
CH0520042489	0.2500 % UBS 0 1/4 01/29/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	92.63%	370'500.00	0.06	a)
CH0537261858	3.2500 % CS 3 1/4 04/02/26 EMTN	500	600	500	600 EUR	91.38%	548'250.00	0.09	a)
CH0576402181	0.2500 % UBS 0 1/4 11/05/28 EMTN	350	0	0	350 EUR	83.32%	291'630.50	0.05	a)
CH0591979627	0.6250 % CS 0 5/8 01/18/33 EMTN	450	300	450	300 EUR	58.22%	174'669.00	0.03	a)
CH0595205524	0.2500 % UBS 0 1/4 02/24/28	300	0	0	300 EUR	82.62%	247'872.00	0.04	a)
CH0595205532	0.6250 % UBS 0 5/8 02/24/33	400	0	0	400 EUR	72.02%	288'088.00	0.05	a)
CH1120418079	0.0000 % BAER 0 06/25/24	0	200	0	200 EUR	94.21%	188'420.00	0.03	a)
CH1130818847	0.5000 % SLHNVX 0 1/2 09/15/31	0	150	0	150 EUR	73.52%	110'277.00	0.02	a)
CH1142231682	0.2500 % UBS 0 1/4 11/03/26	200	0	0	200 EUR	89.93%	179'866.00	0.03	a)
CH1142231690	0.8750 % UBS 0 7/8 11/03/31	400	0	0	400 EUR	75.67%	302'672.00	0.05	a)
CH1168499791	1.0000 % UBS 1 03/21/25 EMTN	0	250	0	250 EUR	96.77%	241'922.50	0.04	a)
CH1174335732	2.1250 % CS 2 1/8 10/13/26	0	1'300	600	700 EUR	86.50%	605'500.00	0.10	a)
CH1174335740	2.8750 % CS 2 7/8 04/02/32	0	950	450	500 EUR	73.63%	368'125.00	0.06	a)
CH1194000340	2.7500 % UBS 2 3/4 06/15/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	95.24%	285'729.00	0.05	a)
CH1194000357	3.1250 % UBS 3 1/8 06/15/30 EMTN	0	350	0	350 EUR	93.35%	326'718.00	0.06	a)
CH1210198136	3.2500 % SLHNVX 3 1/4 08/31/29	0	200	0	200 EUR	95.70%	191'402.00	0.03	a)
CH1214797172	7.7500 % CS 7 3/4 03/01/29	0	1'000	0	1'000 EUR	99.88%	998'750.00	0.17	a)
CH1224575899	5.2300 % RAIFFS 5.23 11/01/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.73%	205'464.00	0.04	a)
DE000A11QSB8	1.8750 % MBGGR 1 7/8 07/08/24 EMTN	150	0	0	150 EUR	97.88%	146'812.50	0.03	a)
DE000A13R7Z7	3.3750 % ALVGR 3 3/8 PERP	300	0	0	300 EUR	96.63%	289'875.00	0.05	a)
DE000A13SL26	1.1250 % SAPGR 1 1/8 02/20/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A13SL34	1.7500 % SAPGR 1 3/4 02/22/27 EMTN	450	0	0	450 EUR	94.27%	424'206.00	0.07	a)
DE000A14J9N8	2.2410 % ALVGR 2.241 07/07/45	400	0	0	400 EUR	93.75%	375'000.00	0.06	a)
DE000A14KJF5	1.0000 % SAPGR 1 04/01/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.22%	96'221.00	0.02	a)
DE000A169G15	1.4000 % MBGGR 1.4 01/12/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A169NB4	0.7500 % MBGGR 0 3/4 05/11/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A169NC2	1.3750 % MBGGR 1 3/8 05/11/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	89.52%	358'096.00	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
DE000A180B80	1.3750 % ALVGR 1 3/8 04/21/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	85.82%	257'469.00	0.04	a)
DE000A182VT2	1.5000 % ANNGR 1 1/2 06/10/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.61%	183'218.00	0.03	a)
DE000A185QA5	0.3750 % EVKGR 0 3/8 09/07/24 EMTN	250	0	0	250 EUR	95.19%	237'967.50	0.04	a)
DE000A185QB3	0.7500 % EVKGR 0 3/4 09/07/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.41%	170'814.00	0.03	a)
DE000A188WW1	0.7500 % BASGR 0 3/4 11/10/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	91.75%	229'367.50	0.04	a)
DE000A189ZX0	1.2500 % ANNGR 1 1/4 12/06/24 EMTN	500	0	0	500 EUR	95.27%	476'360.00	0.08	a)
DE000A18V146	2.2500 % ANNGR 2 1/4 12/15/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A190NE4	1.0000 % MBGGR 1 11/11/25 EMTN	350	0	0	350 EUR	93.59%	327'575.50	0.06	a)
DE000A1919G4	1.7500 % JABHOL 1 3/4 06/25/26	100	0	0	100 EUR	92.98%	92'984.00	0.02	a)
DE000A1919H2	2.5000 % JABHOL 2 1/2 06/25/29 11Y	300	0	0	300 EUR	89.77%	269'313.00	0.05	a)
DE000A192ZH7	0.8750 % ANNGR 0 7/8 07/03/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A194DD9	0.8750 % MBGGR 0 7/8 04/09/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.07%	291'222.00	0.05	a)
DE000A194DE7	1.5000 % MBGGR 1 1/2 02/09/27 EMTN	150	0	0	150 EUR	92.62%	138'933.00	0.02	a)
DE000A1988E2	1.7500 % ANNGR 1 3/4 01/25/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	90.84%	363'356.00	0.06	a)
DE000A19HCX8	2.0000 % JABHOL 2 05/18/28	300	0	0	300 EUR	89.56%	268'692.00	0.05	a)
DE000A19NS93	1.1250 % ANNGR 1 1/8 09/08/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.68%	185'358.00	0.03	a)
DE000A19S4U8	0.2500 % ALVGR 0 1/4 06/06/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A19S4V6	0.8750 % ALVGR 0 7/8 12/06/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.48%	268'452.00	0.05	a)
DE000A19UR61	0.7500 % ANNGR 0 3/4 01/15/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A19UR79	1.5000 % ANNGR 1 1/2 01/14/28	300	0	0	300 EUR	87.04%	261'105.00	0.04	a)
DE000A19X8A4	1.5000 % ANNGR 1 1/2 03/22/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.02%	276'060.00	0.05	a)
DE000A19X8C0	2.7500 % ANNGR 2 3/4 03/22/38 EMTN	300	0	0	300 EUR	76.78%	230'340.00	0.04	a)
DE000A1HG1K6	3.0000 % ALVGR 3 03/13/28 61	200	0	0	200 EUR	98.60%	197'192.00	0.03	a)
DE000A1R0691	2.3750 % MBGGR 2 3/8 03/08/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A1UDWN5	2.8750 % SIEGR 2 7/8 03/10/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.47%	292'410.00	0.05	a)
DE000A1YQC29	4.7500 % ALVGR 4 3/4 PERP EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A1Z0TA4	1.6250 % JABHOL 1 5/8 04/30/25	500	0	100	400 EUR	95.46%	381'856.00	0.07	a)
DE000A1ZY989	1.5000 % ANNGR 1 1/2 03/31/25 DIP	160	0	0	160 EUR	96.18%	153'883.20	0.03	a)
DE000A1ZZ028	1.0000 % BMW 1 04/20/27 EMTN	500	0	100	400 EUR	90.39%	361'548.00	0.06	a)
DE000A254P51	0.8750 % LEGGR 0 7/8 11/28/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.73%	169'456.00	0.03	a)
DE000A254TM8	2.1210 % ALVGR 2.121 07/08/50 EMTN	300	0	0	300 EUR	82.38%	247'125.00	0.04	a)
DE000A287179	1.0000 % ANNGR 1 01/28/41 EMTN	200	0	0	200 EUR	53.58%	107'164.00	0.02	a)
DE000A289DC9	0.2500 % BASGR 0 1/4 06/05/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.51%	175'022.00	0.03	a)
DE000A289LU4	0.2500 % AARB 0 1/4 11/23/27 304	0	200	0	200 EUR	82.09%	164'182.00	0.03	a)
DE000A289N78	1.2500 % DBOERS 1 1/4 06/16/47	0	200	0	200 EUR	87.88%	175'750.00	0.03	a)
DE000A289NF1	1.5000 % DWNIGY 1 1/2 04/30/30	200	0	0	200 EUR	80.26%	160'520.00	0.03	a)
DE000A289NX4	0.6250 % EVKGR 0 5/8 09/18/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.03%	184'056.00	0.03	a)
DE000A289QR9	0.7500 % MBGGR 0 3/4 09/10/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.89%	163'772.00	0.03	a)
DE000A289RN6	2.6250 % MBGGR 2 5/8 04/07/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.29%	294'861.00	0.05	a)
DE000A289XG8	2.3750 % MBGGR 2 3/8 05/22/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.29%	184'572.00	0.03	a)
DE000A289XH6	1.6250 % MBGGR 1 5/8 08/22/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A289XJ2	2.0000 % MBGGR 2 08/22/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	95.23%	380'924.00	0.07	a)
DE000A28RSQ8	0.0000 % ALVGR 0 01/14/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	93.54%	187'072.00	0.03	a)
DE000A28RSR6	0.5000 % ALVGR 0 1/2 01/14/31 EMTN	300	0	100	200 EUR	80.24%	160'476.00	0.03	a)
DE000A28V301	2.5000 % JABHOL 2 1/2 04/17/27	200	0	0	200 EUR	94.44%	188'884.00	0.03	a)
DE000A28V319	3.3750 % JABHOL 3 3/8 04/17/35	100	0	0	100 EUR	86.23%	86'225.00	0.01	a)
DE000A28VQC4	1.6250 % ANNGR 1 5/8 04/07/24 EMTN	100	100	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A28VQD2	2.2500 % ANNGR 2 1/4 04/07/30	300	0	0	300 EUR	85.26%	255'792.00	0.04	a)
DE000A2AAL31	1.5000 % MBGGR 1 1/2 03/09/26 EMTN	450	0	0	450 EUR	94.17%	423'760.50	0.07	a)
DE000A2BPA51	0.8750 % BASGR 0 7/8 10/06/31 EMTN	249	151	0	400 EUR	78.82%	315'284.00	0.05	a)
DE000A2DADM7	0.8500 % MBGGR 0.85 02/28/25 EMTN	350	0	0	350 EUR	94.99%	332'475.50	0.06	a)
DE000A2DAHNE6	3.0990 % ALVGR 3.099 07/06/47	300	0	0	300 EUR	93.13%	279'375.00	0.05	a)
DE000A2G8VT5	1.0000 % SAPGR 1 03/13/26	300	0	0	300 EUR	93.32%	279'957.00	0.05	a)
DE000A2GSCW3	1.5000 % MBGGR 1 1/2 07/03/29 EMTN	500	0	0	500 EUR	87.88%	439'400.00	0.08	a)
DE000A2GSCX1	2.1250 % MBGGR 2 1/8 07/03/37 EMTN	450	0	0	450 EUR	80.66%	362'983.50	0.06	a)
DE000A2GSLYO	1.0000 % MBGGR 1 11/15/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.90%	269'688.00	0.05	a)
DE000A2LQ5M4	1.7500 % HOTGR 1 3/4 07/03/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	95.55%	238'870.00	0.04	a)
DE000A2LQJ75	1.1250 % DBOERS 1 1/8 03/26/28	250	0	0	250 EUR	89.88%	224'710.00	0.04	a)
DE000A2LQRS3	2.2500 % DT 2 1/4 03/29/39 EMTN	0	200	0	200 EUR	80.67%	161'334.00	0.03	a)
DE000A2R7JE1	1.1250 % ANNGR 1 1/8 09/14/34 EMTN	100	0	0	100 EUR	67.70%	67'697.00	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
DE000A2R9ZT1	0.2500 % MBGGR 0 1/4 11/06/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2R9ZU9	0.6250 % MBGGR 0 5/8 05/06/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.92%	177'842.00	0.03 a)	
DE000A2RWAX4	0.8750 % ALVGR 0 7/8 01/15/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.91%	185'816.00	0.03 a)	
DE000A2RWAY2	1.5000 % ALVGR 1 1/2 01/15/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.55%	177'096.00	0.03 a)	
DE000A2RYD83	0.6250 % MBGGR 0 5/8 02/27/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2RYD91	1.3750 % MBGGR 1 3/8 06/26/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.30%	186'602.00	0.03 a)	
DE000A2SBDE0	1.0000 % JABHOL 1 12/20/27	100	0	0	100 EUR	86.79%	86'786.00	0.01 a)	
DE000A2S8DF7	2.2500 % JABHOL 2 1/4 12/19/39	300	0	0	300 EUR	68.65%	205'935.00	0.04 a)	
DE000A2TR083	2.0000 % MBGGR 2 02/27/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.21%	264'624.00	0.05 a)	
DE000A2TSDE2	1.7500 % DT 1 3/4 03/25/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.34%	174'682.00	0.03 a)	
DE000A2TSTE8	0.7500 % SAPGR 0 3/4 12/10/24	300	0	0	300 EUR	95.32%	285'966.00	0.05 a)	
DE000A2TSTF5	1.2500 % SAPGR 1 1/4 03/10/28	300	0	0	300 EUR	90.33%	270'975.00	0.05 a)	
DE000A2TSTG3	1.6250 % SAPGR 1 5/8 03/10/31	400	0	0	400 EUR	87.12%	348'484.00	0.06 a)	
DE000A2YNZW8	0.3750 % MBGGR 0 3/8 11/08/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	89.39%	223'485.00	0.04 a)	
DE000A2YNZX6	0.7500 % MBGGR 0 3/4 02/08/30 EMTN	250	250	0	250 EUR	82.50%	206'257.50	0.04 a)	
DE000A2YNZY4	1.1250 % MBGGR 1 1/8 08/08/34 EMTN	150	0	0	150 EUR	75.43%	113'139.00	0.02 a)	
DE000A2YPFA1	1.3010 % ALVGR 1.301 09/25/49	300	0	0	300 EUR	79.63%	238'875.00	0.04 a)	
DE000A2YPFU9	1.1250 % MBGGR 1 1/8 11/06/31 EMTN	350	0	0	350 EUR	80.63%	282'187.50	0.05 a)	
DE000A30VGD9	2.6250 % HERAEU 2 5/8 06/09/27	0	200	0	200 EUR	91.97%	183'936.00	0.03 a)	
DE000A30VJZ6	4.2520 % ALVGR 4.252 07/05/52 EMTN	0	400	0	400 EUR	93.50%	374'000.00	0.06 a)	
DE000A30VPM1	3.9710 % AMPRIO 3.971 09/22/32	0	300	0	300 EUR	99.77%	299'301.00	0.05 a)	
DE000A30VT06	5.0000 % DB 5 09/05/30	0	300	0	300 EUR	97.38%	292'125.00	0.05 a)	
DE000A30VTT8	4.5970 % ALVGR 4.597 09/07/38 EMTN	0	300	0	300 EUR	97.88%	293'625.00	0.05 a)	
DE000A3E5FR9	0.6250 % ANNGR 0 5/8 03/24/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	73.19%	146'376.00	0.03 a)	
DE000A3E5L98	0.2500 % EWE 0 1/4 06/08/28 EMTN	150	0	0	150 EUR	83.75%	125'628.00	0.02 a)	
DE000A3E5MG8	0.3750 % ANNGR 0 3/8 06/16/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	84.24%	252'726.00	0.04 a)	
DE000A3E5MH6	0.6250 % ANNGR 0 5/8 12/14/29 EMTN	500	0	0	500 EUR	76.89%	384'460.00	0.07 a)	
DE000A3E5MJ2	1.0000 % ANNGR 1 06/16/33	300	0	0	300 EUR	68.67%	206'019.00	0.04 a)	
DE000A3E5MK0	1.5000 % ANNGR 1 1/2 06/14/41	200	0	0	200 EUR	58.76%	117'526.00	0.02 a)	
DE000A3E5QW6	0.1250 % GEWWOH 0 1/8 06/24/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	84.10%	168'200.00	0.03 a)	
DE000A3E5S00	0.6250 % HOTGR 0 5/8 04/26/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.58%	157'168.00	0.03 a)	
DE000A3E5VK1	0.7500 % LEGGR 0 3/4 06/30/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	74.48%	148'966.00	0.03 a)	
DE000A3E5VX4	0.6250 % AMPRIO 0 5/8 09/23/33 EMTN	300	0	0	300 EUR	70.35%	211'035.00	0.04 a)	
DE000A3H2457	0.0000 % DBOERS 0 02/22/26	200	0	0	200 EUR	90.38%	180'752.00	0.03 a)	
DE000A3H2465	0.1250 % DBOERS 0 1/8 02/22/31	200	0	0	200 EUR	77.39%	154'770.00	0.03 a)	
DE000A3H2TW4	0.3750 % EWE 0 3/8 10/22/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	69.94%	139'872.00	0.02 a)	
DE000A3H3GE7	0.0000 % HOWOGE 0 11/01/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.00%	186'000.00	0.03 a)	
DE000A3H3GF4	0.6250 % HOWOGE 0 5/8 11/01/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.92%	163'830.00	0.03 a)	
DE000A3H3GG2	1.1250 % HOWOGE 1 1/8 11/01/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	73.51%	147'012.00	0.03 a)	
DE000A3H3J14	0.0000 % VANTOW 0 03/31/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.93%	95'931.00	0.02 a)	
DE000A3H3J22	0.3750 % VANTOW 0 3/8 03/31/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.71%	187'418.00	0.03 a)	
DE000A3H3J30	0.7500 % VANTOW 0 3/4 03/31/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	91.78%	275'349.00	0.05 a)	
DE000A3H3JM4	0.7500 % MBGGR 0 3/4 03/11/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	74.91%	149'820.00	0.03 a)	
DE000A3H3JU7	0.8750 % LEGGR 0 7/8 03/30/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	69.29%	138'574.00	0.02 a)	
DE000A3K5HW7	4.7500 % JABHOL 4 3/4 06/29/32	0	200	0	200 EUR	101.18%	202'354.00	0.03 a)	
DE000A3KY342	0.0000 % ALVGR 0 11/22/26	0	200	0	200 EUR	88.33%	176'654.00	0.03 a)	
DE000A3KY359	0.5000 % ALVGR 0 1/2 11/22/33	0	100	0	100 EUR	74.12%	74'123.00	0.01 a)	
DE000A3LBMY2	3.0000 % MBGGR 3 02/23/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	97.64%	292'908.00	0.05 a)	
DE000A3MP4T1	0.0000 % ANNGR 0 12/01/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	89.05%	178'104.00	0.03 a)	
DE000A3MP4U9	0.2500 % ANNGR 0 1/4 09/01/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	79.78%	319'124.00	0.05 a)	
DE000A3MP4V7	0.7500 % ANNGR 0 3/4 09/01/32 EMTN	400	0	0	400 EUR	69.38%	277'524.00	0.05 a)	
DE000A3MP4W5	1.6250 % ANNGR 1 5/8 09/01/51 EMTN	200	0	0	200 EUR	50.76%	101'524.00	0.02 a)	
DE000A3MQMD2	1.0000 % LEGGR 1 11/19/32	100	0	0	100 EUR	71.75%	71'751.00	0.01 a)	
DE000A3MQNN9	0.3750 % LEGGR 0 3/8 01/17/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.22%	89'223.00	0.02 a)	
DE000A3MQNQ2	1.5000 % LEGGR 1 1/2 01/17/34 EMTN	200	0	0	200 EUR	72.20%	144'408.00	0.02 a)	
DE000A3MQQV5	2.0000 % DBOERS 2 06/23/48	0	100	0	100 EUR	87.13%	87'125.00	0.02 a)	
DE000A3MQS56	1.3750 % ANNGR 1 3/8 01/28/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	92.28%	276'825.00	0.05 a)	
DE000A3MQS64	1.8750 % ANNGR 1 7/8 06/28/28	0	200	0	200 EUR	88.10%	176'198.00	0.03 a)	
DE000A3MQS72	2.3750 % ANNGR 2 3/8 03/25/32	0	300	0	300 EUR	82.27%	246'798.00	0.04 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
DE000AAR0264	0.5000 % AARB 0 1/2 04/07/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	84.98%	169'954.00	0.03	a)
DE000AAR0298	0.0500 % AARB 0.05 09/02/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	85.35%	170'694.00	0.03	a)
DE000AAR0322	0.7500 % AARB 0 3/4 04/18/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	82.91%	165'812.00	0.03	a)
DE000BHYOA56	1.2500 % BHH 1 1/4 01/22/25 EMTN	300	0	100	200 EUR	94.77%	189'536.00	0.03	a)
DE000BHYOBP6	1.0000 % BHH 1 02/05/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.70%	183'394.00	0.03	a)
DE000BHYOGA7	0.5000 % BHH 0 1/2 11/05/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.04%	160'070.00	0.03	a)
DE000BHYOGB5	1.5000 % BHH 1 1/2 04/18/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.39%	182'770.00	0.03	a)
DE000BHYOGS9	1.1250 % BHH 1 1/8 10/25/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	88.53%	177'066.00	0.03	a)
DE000BHYOGU5	0.5000 % BHH 0 1/2 09/26/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BHYOSL9	0.3750 % BHH 0 3/8 04/21/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	74.40%	74'399.00	0.01	a)
DE000BLB6JJO	0.1250 % BYLAN 0 1/8 02/10/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	82.76%	82'760.00	0.01	a)
DE000CB0HRQ9	0.7500 % CMZB 0 3/4 03/24/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.25%	184'500.00	0.03	a)
DE000CB0HRY3	0.1000 % CMZB 0.1 09/11/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	91.43%	228'580.00	0.04	a)
DE000CZ40L63	1.1250 % CMZB 1 1/8 05/24/24 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.92%	96'918.00	0.02	a)
DE000CZ40LD5	4.0000 % CMZB 4 03/23/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.70%	293'091.00	0.05	a)
DE000CZ40LR5	0.5000 % CMZB 0 1/2 09/13/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000CZ40LW5	4.0000 % CMZB 4 03/30/27 EMTN	260	0	0	260 EUR	96.88%	251'882.80	0.04	a)
DE000CZ40M21	0.5000 % CMZB 0 1/2 08/28/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000CZ40M39	1.5000 % CMZB 1 1/2 08/28/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.54%	268'614.00	0.05	a)
DE000CZ40MC5	1.1250 % CMZB 1 1/8 09/19/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.42%	184'838.00	0.03	a)
DE000CZ40N04	0.6250 % CMZB 0 5/8 08/28/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.44%	286'311.00	0.05	a)
DE000CZ40N46	1.1250 % CMZB 1 1/8 06/22/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.67%	179'332.00	0.03	a)
DE000CZ40NG4	1.2500 % CMZB 1 1/4 10/23/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000CZ40NS9	1.0000 % CMZB 1 03/04/26 EMTN	350	0	0	350 EUR	92.12%	322'427.00	0.06	a)
DE000CZ43ZB3	4.6250 % CMZB 4 5/8 03/21/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.25%	198'500.00	0.03	a)
DE000CZ45V82	0.3750 % CMZB 0 3/8 09/01/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.56%	173'120.00	0.03	a)
DE000CZ45VB7	0.2500 % CMZB 0 1/4 09/16/24 EMTN	0	200	0	200 EUR	94.40%	188'794.00	0.03	a)
DE000CZ45VC5	0.5000 % CMZB 0 1/2 12/04/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.63%	177'264.00	0.03	a)
DE000CZ45VM4	0.8750 % CMZB 0 7/8 01/22/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.07%	174'140.00	0.03	a)
DE000CZ45W81	6.5000 % CMZB 6 1/2 12/06/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.13%	200'250.00	0.03	a)
DE000CZ45WP5	1.3750 % CMZB 1 3/8 12/29/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	83.63%	83'625.00	0.01	a)
DE000DB7XJP9	1.1250 % DB 1 1/8 03/17/25 EMTN	300	200	0	500 EUR	94.65%	473'260.00	0.08	a)
DE000DFKOL29	0.8750 % DZBK 0 7/8 10/15/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	79.37%	158'744.00	0.03	a)
DE000DL19T26	1.7500 % DB 1 3/4 01/17/28 EMTN	500	0	0	500 EUR	87.09%	435'445.00	0.07	a)
DE000DL19U23	1.6250 % DB 1 5/8 01/20/27 EMTN	200	300	0	500 EUR	88.77%	443'860.00	0.08	a)
DE000DL19UC0	1.1250 % DB 1 1/8 08/30/23 MTN	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000DL19US6	2.6250 % DB 2 5/8 02/12/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.28%	285'843.00	0.05	a)
DE000DL19VD6	1.3750 % DB 1 3/8 06/10/26 EMTN	700	0	0	700 EUR	94.25%	659'750.00	0.11	a)
DE000DL19VP0	1.3750 % DB 1 3/8 09/03/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.75%	183'500.00	0.03	a)
DE000DL19VR6	1.0000 % DB 1 11/19/25 EMTN	600	0	0	600 EUR	94.38%	566'250.00	0.10	a)
DE000DL19VS4	1.7500 % DB 1 3/4 11/19/30 EMTN	500	0	0	500 EUR	79.88%	399'375.00	0.07	a)
DE000DL19VT2	0.7500 % DB 0 3/4 02/17/27 EMTN	300	200	0	500 EUR	88.63%	443'125.00	0.08	a)
DE000DL19VU0	1.3750 % DB 1 3/8 02/17/32	400	0	0	400 EUR	74.88%	299'500.00	0.05	a)
DE000DL19WL7	1.8750 % DB 1 7/8 02/23/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	88.50%	177'000.00	0.03	a)
DE000DL19WU8	3.2500 % DB 3 1/4 05/24/28	0	300	0	300 EUR	93.13%	279'375.00	0.05	a)
DE000GRN0024	0.0100 % DKRED 0.01 02/23/26	200	0	0	200 EUR	89.41%	178'810.00	0.03	a)
DE000HCBOAY6	0.7500 % HCOB 0 3/4 11/23/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000HCBOAZ3	0.3750 % HCOB 0 3/8 03/09/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.02%	174'038.00	0.03	a)
DE000LB13HZ5	2.2000 % LBBW 2.2 05/09/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	82.60%	165'198.00	0.03	a)
DE000LB2CHW4	0.3750 % LBBW 0 3/8 05/24/24 806	200	0	0	200 EUR	95.65%	191'294.00	0.03	a)
DE000LB2CLH7	0.3750 % LBBW 0 3/8 07/29/26 809	200	0	0	200 EUR	88.45%	176'900.00	0.03	a)
DE000LB2CNE0	0.3750 % LBBW 0 3/8 09/30/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.62%	169'234.00	0.03	a)
DE000LB2CRG6	0.3750 % LBBW 0 3/8 02/18/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.38%	172'750.00	0.03	a)
DE000LB2CW16	0.3750 % LBBW 0 3/8 02/21/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	74.22%	148'446.00	0.03	a)
DE000LB2V5T1	0.3750 % LBBW 0 3/8 05/07/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	78.89%	78'887.00	0.01	a)
DE000LB2V7C3	0.2500 % LBBW 0 1/4 07/21/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	82.01%	164'026.00	0.03	a)
DE000LB2V833	0.3750 % LBBW 0 3/8 02/28/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	83.75%	167'498.00	0.03	a)
DE000MHB64E1	0.3750 % MUNHYP 0 3/8 03/09/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	79.27%	158'544.00	0.03	a)
DE000NLB3UX1	0.0100 % NDB 0.01 09/23/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	88.55%	177'096.00	0.03	a)
DE000TLX2102	2.5000 % TALANX 2 1/2 07/23/26	300	200	300	200 EUR	95.16%	190'318.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
DK0009522062	0.6250 % NYKRE 0 5/8 01/17/25 EMTN	150	0	0	150 EUR	93.72%	140'574.00	0.02	a)
DK0009522732	0.8750 % NYKRE 0 7/8 01/17/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DK0009525404	0.1250 % NYKRE 0 1/8 07/10/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.61%	189'228.00	0.03	a)
DK0009526998	0.7500 % NYKRE 0 3/4 01/20/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.11%	174'210.00	0.03	a)
DK0009529901	0.5000 % NYKRE 0 1/2 07/10/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.76%	183'518.00	0.03	a)
DK0030467105	0.2500 % NYKRE 0 1/4 01/13/26	300	0	0	300 EUR	89.09%	267'267.00	0.05	a)
DK0030484548	0.3750 % NYKRE 0 3/8 01/17/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	82.48%	206'197.50	0.04	a)
DK0030487996	0.8750 % NYKRE 0 7/8 07/28/31	0	100	0	100 EUR	85.88%	85'875.00	0.01	a)
DK0030506886	1.3750 % NYKRE 1 3/8 07/12/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	89.08%	89'083.00	0.02	a)
DK0030507694	5.5000 % NYKRE 5 1/2 12/29/32	0	200	0	200 EUR	99.75%	199'500.00	0.03	a)
ES0205032024	1.3750 % FERSM 1 3/8 03/31/25	300	0	0	300 EUR	94.77%	284'309.61	0.05	a)
ES0205032040	0.5400 % FERSM 0.54 11/12/28	100	0	0	100 EUR	80.90%	80'901.00	0.01	a)
ES0205045026	0.8750 % CAIXAB 0 7/8 10/28/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.00%	171'990.00	0.03	a)
ES0205061007	1.6800 % CNGEST 1.68 02/26/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.54%	191'080.32	0.03	a)
ES0211845260	3.7500 % ABESM 3 3/4 06/20/23	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0211845294	2.5000 % ABESM 2 1/2 02/27/25 CNMV	200	0	0	200 EUR	97.10%	194'203.48	0.03	a)
ES0211845302	1.3750 % ABESM 1 3/8 05/20/26	200	0	0	200 EUR	91.82%	183'638.94	0.03	a)
ES0213307053	0.7500 % CABKSM 0 3/4 07/09/26	200	0	0	200 EUR	89.32%	178'640.00	0.03	a)
ES0213307061	1.1250 % CABKSM 1 1/8 11/12/26	200	0	0	200 EUR	89.16%	178'318.00	0.03	a)
ES0213679HN2	0.8750 % BKTSM 0 7/8 07/08/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.50%	179'008.00	0.03	a)
ES0213679JR9	0.6250 % BKTSM 0 5/8 10/06/27	100	0	0	100 EUR	85.69%	85'694.00	0.01	a)
ES0213679OF4	1.2500 % BKTSM 1 1/4 12/23/32	200	0	0	200 EUR	82.68%	165'368.00	0.03	a)
ES0224244071	1.6250 % MAPSM 1 5/8 05/19/26	300	0	0	300 EUR	92.05%	276'152.85	0.05	a)
ES0224244089	4.3750 % MAPSM 4 3/8 03/31/47	200	0	0	200 EUR	96.00%	192'000.00	0.03	a)
ES0239140025	0.7500 % COLSM 0 3/4 06/22/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.68%	161'350.00	0.03	a)
ES0305045009	1.3750 % CAIXAB 1 3/8 04/10/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.23%	194'460.00	0.03	a)
ES0305523005	0.0000 % SIXLTD 0 12/02/25	200	0	0	200 EUR	89.56%	179'122.00	0.03	a)
ES0313307201	0.8750 % CABKSM 0 7/8 03/25/24	200	0	0	200 EUR	96.88%	193'752.00	0.03	a)
ES0313307219	1.0000 % CABKSM 1 06/25/24 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.10%	96'100.55	0.02	a)
ES0313679K13	0.8750 % BKTSM 0 7/8 03/05/24	200	0	0	200 EUR	96.99%	193'984.00	0.03	a)
FR0000471930	8.1250 % ORAFP 8 1/8 01/28/33 EMTN	310	100	0	410 EUR	134.25%	550'412.66	0.09	a)
FR0010033381	6.1250 % VIEFP 6 1/8 11/25/33 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0010800540	4.6250 % EDF 4 5/8 09/11/24 EMTN	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0010891317	4.6250 % EDF 4 5/8 04/26/30 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0010961540	4.0000 % EDF 4 11/12/25 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0010961581	4.5000 % EDF 4 1/2 11/12/40 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011185636	4.0000 % SAGESS 4 01/24/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011224963	4.6250 % VIEFP 4 5/8 03/30/27 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011225143	4.1250 % EDF 4 1/8 03/25/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011266527	3.1250 % ADPPF 3 1/8 06/11/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	99.45%	198'908.00	0.03	a)
FR0011280056	4.2500 % BPCEGP 4 1/4 02/06/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011318658	2.7500 % EDF 2 3/4 03/10/23 EMTN	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011390921	2.8750 % BPCEGP 2 7/8 01/16/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011439785	2.6250 % SAGESS 2 5/8 03/06/25	200	0	0	200 EUR	98.19%	196'380.00	0.03	a)
FR0011509488	2.7500 % ADPPF 2 3/4 06/05/28	300	0	0	300 EUR	95.69%	287'079.00	0.05	a)
FR0011527241	2.6000 % BNFP 2.6 06/28/23 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011538222	4.6250 % BPCEGP 4 5/8 07/18/23	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011560077	3.1250 % ORAFP 3 1/8 01/09/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011565555	2.8750 % RTEFRA 2 7/8 09/12/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011625433	2.5000 % SANFP 2 1/2 11/14/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011625482	3.1500 % ACAFP 3.15 12/23/23	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011689033	3.2500 % FRFP 3 1/4 01/22/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	99.41%	198'828.00	0.03	a)
FR0011689579	3.0000 % BPCEGP 3 07/19/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.92%	197'830.00	0.03	a)
FR0011694033	2.9500 % DGFP 2.95 01/17/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011697028	5.0000 % EDF 5 PERP EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011832039	2.7500 % KERFP 2 3/4 04/08/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	99.47%	298'398.00	0.05	a)
FR0011911247	2.3750 % ENGIFP 2 3/8 05/19/26 EMTN	0	1'000	400	600 EUR	96.12%	576'708.00	0.10	a)
FR0011949403	4.2500 % CNPFP 4 1/4 06/05/45	200	0	0	200 EUR	98.38%	196'750.00	0.03	a)
FR0011951771	1.8750 % AIFP 1 7/8 06/05/24 EMTN	400	0	0	400 EUR	98.29%	393'140.00	0.07	a)
FR0011991488	2.7500 % RTEFRA 2 3/4 06/20/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR0012146801	1.7500 % SANFP 1 3/4 09/10/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	94.39%	377'540.00	0.07	a)
FR0012173862	2.1250 % RIFF 2 1/8 09/27/24	300	0	0	300 EUR	97.61%	292'830.00	0.05	a)
FR0012199065	1.6250 % RTEFRA 1 5/8 10/08/24 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012206993	1.5000 % ADPPF 1 1/2 04/07/25	200	0	0	200 EUR	95.31%	190'620.00	0.03	a)
FR0012222297	4.5000 % ACAFP 4 1/2 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012236669	2.1250 % VPARKI 2 1/8 04/16/25	200	0	0	200 EUR	96.03%	192'056.00	0.03	a)
FR0012300812	1.8750 % ARRF 1 7/8 01/15/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	96.44%	385'776.00	0.07	a)
FR0012329845	4.0320 % BNP 4.032 PERP	300	0	0	300 EUR	96.13%	288'375.00	0.05	a)
FR0012370872	2.0000 % NK 2 12/10/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.51%	193'026.00	0.03	a)
FR0012383982	4.1250 % SOGES 4 1/8 PERP	300	0	0	300 EUR	95.50%	286'500.00	0.05	a)
FR0012384667	1.6250 % PUBFP 1 5/8 12/16/24	300	0	0	300 EUR	96.17%	288'507.00	0.05	a)
FR0012395689	3.0000 % ACAFP 3 02/02/25	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012432912	1.1250 % BNFP 1 1/8 01/14/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	95.61%	478'045.00	0.08	a)
FR0012444750	4.2500 % ACAFP 4 1/4 PERP	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012448025	1.5000 % GFCFP 1 1/2 01/20/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.54%	286'605.00	0.05	a)
FR0012452191	1.5000 % AKEFP 1 1/2 01/20/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	96.09%	480'445.00	0.08	a)
FR0012599892	1.3750 % EDENFP 1 3/8 03/10/25	200	0	0	200 EUR	95.21%	190'418.00	0.03	a)
FR0012601367	0.8750 % SUFP 0 7/8 03/11/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.85%	189'702.00	0.03	a)
FR0012602761	1.0000 % ENGIFP 1 03/13/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	91.99%	275'973.00	0.05	a)
FR0012663169	1.5900 % VIEFP 1.59 01/10/28 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012766889	1.2500 % AIFP 1 1/4 06/03/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.35%	192'696.00	0.03	a)
FR0012821940	2.5000 % CAPFP 2 1/2 07/01/23	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012861821	1.5000 % ADPPF 1 1/2 07/24/23	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012881555	2.2000 % TERE 2.2 08/05/25	200	0	0	200 EUR	96.41%	192'816.00	0.03	a)
FR0012939841	1.5000 % SUFP 1 1/2 09/08/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012949923	1.7500 % VIEFP 1 3/4 09/10/25 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012969038	1.5000 % SANFP 1 1/2 09/22/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.20%	285'588.00	0.05	a)
FR0012969129	1.5000 % SAGES 1 1/2 10/25/27	100	0	0	100 EUR	91.65%	91'647.00	0.02	a)
FR0013044278	1.5000 % ARRF 1 1/2 01/15/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013053329	1.8750 % SANFP 1 7/8 03/16/26	300	0	0	300 EUR	93.72%	281'154.00	0.05	a)
FR0013060209	1.6250 % RTEFRA 1 5/8 11/27/25 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013063609	1.2500 % BNFP 1 1/4 05/30/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.28%	194'564.00	0.03	a)
FR0013066388	4.5000 % CNPFP 4 1/2 06/10/47	200	0	0	200 EUR	98.75%	197'500.00	0.03	a)
FR0013121753	1.8750 % LIFP 1 7/8 02/19/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.59%	189'184.00	0.03	a)
FR0013139482	1.6250 % FRFP 1 5/8 03/18/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.01%	184'016.00	0.03	a)
FR0013143997	0.6250 % SANFP 0 5/8 04/05/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.00%	290'991.00	0.05	a)
FR0013144003	1.1250 % SANFP 1 1/8 04/05/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.34%	268'005.00	0.05	a)
FR0013152899	1.0000 % RTEFRA 1 10/19/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013152907	2.0000 % RTEFRA 2 04/18/36 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013155009	2.8750 % BPCEGP 2 7/8 04/22/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.72%	191'444.00	0.03	a)
FR0013165677	1.2500 % KERFP 1 1/4 05/10/26 EMTN	100	100	0	200 EUR	93.32%	186'634.00	0.03	a)
FR0013169778	1.0000 % RENAUL 1 05/17/23 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013169885	1.0000 % DGFP 1 05/13/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.90%	183'800.00	0.03	a)
FR0013170834	1.8750 % COVFP 1 7/8 05/20/26	100	0	0	100 EUR	93.84%	93'843.00	0.02	a)
FR0013172939	1.5000 % RIFF 1 1/2 05/18/26	200	0	0	200 EUR	93.45%	186'900.00	0.03	a)
FR0013173028	3.2500 % CMARK 3 1/4 06/01/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.81%	191'612.00	0.03	a)
FR0013173432	1.2500 % VIEFP 1 1/4 05/19/28 EMTN	200	400	200	400 EUR	88.07%	352'296.00	0.06	a)
FR0013176310	1.8750 % VIVFP 1 7/8 05/26/26	200	0	0	200 EUR	93.56%	187'112.00	0.03	a)
FR0013179553	1.0000 % DECFP 1 06/01/23	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013181898	3.0000 % FRLBP 3 06/09/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	91.11%	91'108.00	0.02	a)
FR0013181906	1.7500 % ICADFP 1 3/4 06/10/26	300	0	0	300 EUR	93.75%	281'241.00	0.05	a)
FR0013182078	1.1250 % ARRF 1 1/8 01/09/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.19%	279'579.00	0.05	a)
FR0013182847	1.2500 % AIFP 1 1/4 06/13/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.81%	269'418.00	0.05	a)
FR0013201126	0.3750 % DGFP 0 3/8 02/07/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.93%	281'802.00	0.05	a)
FR0013201134	0.7500 % DGFP 0 3/4 09/09/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.50%	171'008.00	0.03	a)
FR0013201308	0.2500 % SUFP 0 1/4 09/09/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.03%	285'084.00	0.05	a)
FR0013201597	0.5000 % RENAUL 0 1/2 09/15/23 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013201639	0.5000 % SANFP 0 1/2 01/13/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.60%	268'800.00	0.05	a)
FR0013203734	4.7500 % ACAFP 4 3/4 09/27/48	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013203825	1.2500 % LIFP 1 1/4 09/29/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	79.33%	237'996.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR0013204468	1.0000 % BPCEGP 1 10/05/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	85.45%	341'808.00	0.06	a)
FR0013204476	0.3750 % BPCEGP 0 3/8 10/05/23 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013205069	1.0000 % GFCFP 1 01/30/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.49%	168'972.00	0.03	a)
FR0013210408	0.3140 % VIEFP 0.314 10/04/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013210416	0.9270 % VIEFP 0.927 01/04/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013213295	1.0000 % EDF 1 10/13/26 EMTN	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013213303	1.8750 % EDF 1 7/8 10/13/36 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013214137	0.6250 % SAGESS 0 5/8 10/20/28	200	0	0	200 EUR	85.81%	171'628.00	0.03	a)
FR0013216918	0.7090 % BNFP 0.709 11/03/24 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.70%	95'698.00	0.02	a)
FR0013216926	1.2080 % BNFP 1.208 11/03/28 EMTN	500	0	0	500 EUR	88.38%	441'905.00	0.08	a)
FR0013217114	0.8750 % ORAFP 0 7/8 02/03/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.99%	269'973.00	0.05	a)
FR0013218393	1.1250 % ICADFP 1 1/8 11/17/25	200	0	0	200 EUR	93.04%	186'078.00	0.03	a)
FR0013220266	1.8750 % ARRF 1 7/8 01/06/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.24%	176'484.00	0.03	a)
FR0013220399	1.1250 % VIVFP 1 1/8 11/24/23	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013222494	1.3750 % ENFP 1 3/8 06/07/27	300	0	0	300 EUR	91.33%	274'002.00	0.05	a)
FR0013231099	1.2500 % DGFP 1 1/4 01/18/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	91.30%	273'900.00	0.05	a)
FR0013231768	1.5000 % NK 1 1/2 01/15/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.66%	90'663.00	0.02	a)
FR0013236544	3.5000 % CMARK 3 1/2 02/09/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.59%	185'176.00	0.03	a)
FR0013238045	1.3750 % LIFP 1 3/8 02/16/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.46%	182'916.00	0.03	a)
FR0013241346	1.0000 % AIFP 1 03/08/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.46%	182'918.00	0.03	a)
FR0013241361	1.3750 % RENAUL 1 3/8 03/08/24 EMTN	400	0	0	400 EUR	97.32%	389'264.00	0.07	a)
FR0013241536	0.7500 % ORAFP 0 3/4 09/11/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013241676	1.5000 % ORAFP 1 1/2 09/09/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.04%	182'072.00	0.03	a)
FR0013245586	2.0000 % STLA 2 03/23/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.24%	294'729.00	0.05	a)
FR0013245859	0.8750 % ENGIFP 0 7/8 03/27/24 EMTN	0	400	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013245867	1.5000 % ENGIFP 1 1/2 03/27/28 EMTN	0	500	0	500 EUR	89.49%	447'445.00	0.08	a)
FR0013247202	1.8750 % EDENFP 1 7/8 03/30/27	300	0	0	300 EUR	93.74%	281'226.00	0.05	a)
FR0013248465	1.5000 % RCF 1 1/2 04/03/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013248507	1.0000 % VIEFP 1 04/03/25 EMTN	0	300	0	300 EUR	94.69%	284'076.00	0.05	a)
FR0013248523	1.5000 % VIEFP 1 1/2 04/03/29 EMTN	200	400	200	400 EUR	87.62%	350'488.00	0.06	a)
FR0013250693	1.6250 % RENAUL 1 5/8 04/11/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.77%	189'536.00	0.03	a)
FR0013251170	1.1250 % DGFP 1 1/8 04/20/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.38%	277'128.00	0.05	a)
FR0013252061	2.8750 % VIEFP 2 7/8 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013257623	0.7500 % MCFP 0 3/4 05/26/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.90%	290'706.00	0.05	a)
FR0013258936	1.2500 % CMARK 1 1/4 05/31/24	200	0	0	200 EUR	96.73%	193'460.00	0.03	a)
FR0013260551	1.6250 % ARRF 1 5/8 01/13/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	83.72%	167'432.00	0.03	a)
FR0013262698	1.5000 % COVFP 1 1/2 06/21/27	200	0	0	200 EUR	90.81%	181'620.00	0.03	a)
FR0013264405	0.8750 % CTEFRA 0 7/8 09/29/24	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013264421	1.5000 % CTEFRA 1 1/2 07/29/28	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013264439	2.1250 % CTEFRA 2 1/8 07/29/32	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013266368	2.0000 % GFCFP 2 06/30/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.50%	170'996.00	0.03	a)
FR0013266830	0.7500 % LRFP 0 3/4 07/06/24	0	100	0	100 EUR	96.30%	96'297.00	0.02	a)
FR0013266848	1.8750 % LRFP 1 7/8 07/06/32	200	0	0	200 EUR	86.53%	173'068.00	0.03	a)
FR0013282571	0.8750 % VIVFP 0 7/8 09/18/24 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.12%	95'122.00	0.02	a)
FR0013283140	1.6250 % VIEFP 1 5/8 09/21/32 EMTN	200	200	200	200 EUR	81.68%	163'354.00	0.03	a)
FR0013284205	1.3750 % GFCFP 1 3/8 01/26/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.16%	180'320.00	0.03	a)
FR0013284254	1.3750 % ENGIFP 1 3/8 02/28/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	87.07%	261'219.00	0.04	a)
FR0013284270	2.0000 % ENGIFP 2 09/28/37 EMTN	0	500	0	500 EUR	75.16%	375'805.00	0.06	a)
FR0013286788	1.1250 % DGFP 1 1/8 10/13/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.83%	179'666.00	0.03	a)
FR0013286838	1.0000 % FRLBP 1 10/16/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.17%	190'330.00	0.03	a)
FR0013290749	1.8750 % RTEFRA 1 7/8 10/23/37 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013291556	1.8750 % CMARK 1 7/8 10/25/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.25%	188'500.00	0.03	a)
FR0013292828	1.7500 % BNFP 1 3/4 PERP EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013295722	1.5000 % ARRF 1 1/2 01/17/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.72%	163'444.00	0.03	a)
FR0013298676	1.6250 % HITTFP 1 5/8 11/27/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.37%	176'748.00	0.03	a)
FR0013298684	0.6250 % HITTFP 0 5/8 03/27/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013299468	1.3500 % CRLOG 1.35 11/28/29	100	0	0	100 EUR	92.75%	92'750.00	0.02	a)
FR0013299641	1.0000 % BNP 1 11/29/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.44%	188'884.00	0.03	a)
FR0013300605	1.6250 % LIFP 1 5/8 12/13/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	79.56%	159'122.00	0.03	a)
FR0013302809	0.8750 % SUFP 0 7/8 12/13/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.67%	181'332.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR0013310224	1.3750 % ORAFP 1 3/8 01/16/30 EMTN	500	0	0	500 EUR	85.38%	426'890.00	0.07	a)
FR0013310455	1.3750 % DGFP 1 3/8 01/22/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.53%	173'054.00	0.03	a)
FR0013311503	1.1250 % SOCGEN 1 1/8 01/23/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	94.79%	379'148.00	0.07	a)
FR0013312154	2.6250 % ACAFP 2 5/8 01/29/48	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013312493	0.8750 % BPCEGP 0 7/8 01/31/24 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013312501	1.6250 % BPCEGP 1 5/8 01/31/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	87.96%	263'889.00	0.05	a)
FR0013320033	1.3750 % SOCGEN 1 3/8 02/23/28 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013320058	1.6250 % ICADFP 1 5/8 02/28/28	200	0	0	200 EUR	88.56%	177'112.00	0.03	a)
FR0013322989	1.6250 % GFCFP 1 5/8 03/14/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.29%	172'574.00	0.03	a)
FR0013323326	2.0000 % STLA 2 03/20/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.39%	289'161.00	0.05	a)
FR0013323664	1.3750 % BPCEGP 1 3/8 03/23/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.11%	276'327.00	0.05	a)
FR0013323722	0.6000 % HSBC 0.6 03/20/23 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013323870	1.3750 % ORAFP 1 3/8 03/20/28 EMTN	500	0	0	500 EUR	89.52%	447'585.00	0.08	a)
FR0013324332	0.5000 % SANFP 0 1/2 03/21/23 5FXD	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013324340	1.0000 % SANFP 1 03/21/26 8FXD	500	0	0	500 EUR	93.04%	465'215.00	0.08	a)
FR0013324357	1.3750 % SANFP 1 3/8 03/21/30 12FX	500	0	0	500 EUR	87.30%	436'515.00	0.08	a)
FR0013324373	1.8750 % SANFP 1 7/8 03/21/38 20FX	300	0	0	300 EUR	81.70%	245'091.00	0.04	a)
FR0013327962	1.0000 % CAPFP 1 10/18/24	100	0	0	100 EUR	95.49%	95'487.00	0.02	a)
FR0013327988	1.7500 % CAPFP 1 3/4 04/18/28	200	0	0	200 EUR	90.77%	181'546.00	0.03	a)
FR0013330099	1.6250 % VPARKI 1 5/8 04/19/28	200	0	0	200 EUR	86.69%	173'374.00	0.03	a)
FR0013330529	2.1250 % ULFP 2 1/8 PERP	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013330537	2.8750 % ULFP 2 7/8 PERP	200	0	0	200 EUR	86.75%	173'500.00	0.03	a)
FR0013332988	1.1250 % ULFP 1 1/8 09/15/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.88%	281'634.00	0.05	a)
FR0013332996	1.8750 % ULFP 1 7/8 01/15/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	82.97%	248'904.00	0.04	a)
FR0013333002	2.2500 % ULFP 2 1/4 05/14/38 EMTN	300	0	0	300 EUR	76.13%	228'390.00	0.04	a)
FR0013334695	1.6250 % RENAUL 1 5/8 05/26/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	91.61%	274'815.00	0.05	a)
FR0013342128	0.8750 % CAFP 0 7/8 06/12/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013342334	1.5000 % FRFP 1 1/2 06/18/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.57%	283'713.00	0.05	a)
FR0013344215	1.3750 % SUFP 1 3/8 06/21/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	91.43%	274'275.00	0.05	a)
FR0013346137	1.3750 % DGFP 1 3/8 06/27/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.46%	268'383.00	0.05	a)
FR0013346822	1.8750 % RCFFP 1 7/8 07/02/25	300	0	100	200 EUR	94.48%	188'964.00	0.03	a)
FR0013349099	2.0000 % FRLBP 2 07/13/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	88.94%	355'744.00	0.06	a)
FR0013357845	0.8750 % MLFP 0 7/8 09/03/25 EUR	200	0	0	200 EUR	93.60%	187'192.00	0.03	a)
FR0013357852	1.7500 % MLFP 1 3/4 09/03/30 EUR	300	0	0	300 EUR	90.00%	269'991.00	0.05	a)
FR0013357860	2.5000 % MLFP 2 1/2 09/03/38	300	0	0	300 EUR	88.57%	265'707.00	0.05	a)
FR0013358124	1.3750 % HSBC 1 3/8 09/04/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.56%	265'689.00	0.05	a)
FR0013359197	1.0000 % ORAFP 1 09/12/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.61%	187'220.00	0.03	a)
FR0013359239	1.8750 % ORAFP 1 7/8 09/12/30 EMTN	500	0	0	500 EUR	87.82%	439'095.00	0.08	a)
FR0013359254	1.6250 % VIEFP 1 5/8 09/17/30 EMTN	300	200	300	200 EUR	85.94%	171'876.00	0.03	a)
FR0013365293	1.8750 % ENGIFP 1 7/8 09/19/33 EMTN	0	400	0	400 EUR	80.46%	321'848.00	0.06	a)
FR0013367406	0.6250 % BPCEGP 0 5/8 09/26/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013367612	4.0000 % EDF 4 PERP	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013367620	1.0000 % DGFP 1 09/26/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.93%	93'932.00	0.02	a)
FR0013367638	1.7500 % DGFP 1 3/4 09/26/30 EMTN	400	0	0	400 EUR	88.01%	352'052.00	0.06	a)
FR0013368164	1.5000 % RTEFRA 1 1/2 09/27/30 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013368172	2.1250 % RTEFRA 2 1/8 09/27/38 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013368545	2.0000 % EDF 2 10/02/30 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013368602	2.1250 % SOCGEN 2 1/8 09/27/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.73%	266'187.00	0.05	a)
FR0013369493	2.0000 % ETLFP 2 10/02/25	200	0	0	200 EUR	91.20%	182'390.00	0.03	a)
FR0013370137	0.8750 % CMARK 0 7/8 10/05/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013371549	2.1250 % ADPPF 2 1/8 10/11/38 EUR	200	0	0	200 EUR	75.48%	150'954.00	0.03	a)
FR0013378452	1.7500 % ATOFP 1 3/4 05/07/25	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013381704	2.3750 % BNP 2 3/8 11/20/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.00%	186'000.00	0.03	a)
FR0013383213	1.7500 % CAFP 1 3/4 05/04/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.88%	187'752.00	0.03	a)
FR0013385473	1.9400 % VIEFP 1.94 01/07/30 EMTN	100	100	100	100 EUR	89.13%	89'132.00	0.02	a)
FR0013385515	0.7500 % ACAFP 0 3/4 12/05/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013386539	0.7500 % BFCM 0 3/4 06/15/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013393774	2.0000 % RENAUL 2 07/11/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.12%	194'236.00	0.03	a)
FR0013394681	0.8920 % VIEFP 0.892 01/14/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013396447	1.0000 % BPCEGP 1 07/15/24	400	0	0	400 EUR	96.32%	385'296.00	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR0013396512	1.1250 % ORAFP 1 1/8 07/15/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.70%	193'404.00	0.03	a)
FR0013396520	2.0000 % ORAFP 2 01/15/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.32%	91'321.00	0.02	a)
FR0013396876	1.5000 % SUFP 1 1/2 01/15/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.30%	91'296.00	0.02	a)
FR0013397320	1.3750 % CMARK 1 3/8 01/17/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.33%	190'662.00	0.03	a)
FR0013397452	1.6250 % DGFP 1 5/8 01/18/29 EMTN	400	0	0	400 EUR	89.99%	359'944.00	0.06	a)
FR0013398070	2.1250 % BNP 2 1/8 01/23/27 EMTN	700	0	0	700 EUR	93.75%	656'229.00	0.11	a)
FR0013398229	3.2500 % ENGIFP 3 1/4 PERP	0	300	0	300 EUR	97.00%	291'000.00	0.05	a)
FR0013399060	2.6250 % ELOFR 2 5/8 01/30/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013399680	2.7500 % CNPFP 2 3/4 02/05/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.40%	180'796.00	0.03	a)
FR0013403441	1.2500 % SOCGEN 1 1/4 02/15/24 EMTN	500	0	0	500 EUR	97.57%	487'850.00	0.08	a)
FR0013404571	1.3750 % DGFP 1 3/8 02/21/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	83.94%	167'876.00	0.03	a)
FR0013405032	1.0000 % ULFP 1 02/27/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.45%	265'359.00	0.05	a)
FR0013405040	1.7500 % ULFP 1 3/4 02/27/34 EMTN	0	300	0	300 EUR	76.68%	230'037.00	0.04	a)
FR0013405537	1.1250 % BNP 1 1/8 08/28/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.14%	192'288.00	0.03	a)
FR0013407418	3.3750 % CMARK 3 3/8 03/11/31	200	0	0	200 EUR	89.38%	178'762.00	0.03	a)
FR0013408960	1.7500 % BFCM 1 3/4 03/15/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	86.16%	258'492.00	0.04	a)
FR0013409844	0.8750 % SANFP 0 7/8 03/21/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	86.91%	86'905.00	0.01	a)
FR0013410818	1.7500 % SOCGEN 1 3/4 03/22/29 EMTN	400	0	0	400 EUR	85.95%	343'788.00	0.06	a)
FR0013412343	1.0000 % BPCEGP 1 04/01/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.02%	282'063.00	0.05	a)
FR0013412707	1.7500 % RENAUL 1 3/4 04/10/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.34%	184'688.00	0.03	a)
FR0013412947	0.7500 % BFCM 0 3/4 06/08/26 EMTN	500	0	0	500 EUR	90.18%	450'890.00	0.08	a)
FR0013413887	2.3750 % ORAFP 2 3/8 PERP EMTN	500	0	0	500 EUR	94.25%	471'250.00	0.08	a)
FR0013414158	1.0000 % IDFMOB 1 05/25/34 EMTN	0	200	0	200 EUR	77.01%	154'014.00	0.03	a)
FR0013414919	3.3750 % ORANOF 3 3/8 04/23/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	96.69%	193'384.00	0.03	a)
FR0013415692	1.3750 % FRLBP 1 3/8 04/24/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.22%	168'448.00	0.03	a)
FR0013416146	2.3750 % ELOFR 2 3/8 04/25/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.99%	284'973.00	0.05	a)
FR0013421369	1.1250 % CMARK 1 1/8 05/23/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	83.73%	83'732.00	0.01	a)
FR0013421815	1.0000 % ACAFP 1 07/03/29 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013422011	1.3750 % BNP 1 3/8 05/28/29 EMTN	400	0	0	400 EUR	83.41%	333'640.00	0.06	a)
FR0013422227	1.6250 % GFCFP 1 5/8 05/29/34 EMTN	0	200	0	200 EUR	77.92%	155'832.00	0.03	a)
FR0013424868	0.6250 % VIVFP 0 5/8 06/11/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.93%	185'854.00	0.03	a)
FR0013424876	1.1250 % VIVFP 1 1/8 12/11/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.72%	171'442.00	0.03	a)
FR0013425139	0.6250 % PUBFP 0 5/8 06/13/25	200	0	0	200 EUR	92.36%	184'712.00	0.03	a)
FR0013425147	1.2500 % PUBFP 1 1/4 06/13/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.23%	174'462.00	0.03	a)
FR0013425154	1.7500 % PUBFP 1 3/4 06/13/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	83.55%	167'104.00	0.03	a)
FR0013425162	1.8750 % BFCM 1 7/8 06/18/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	83.23%	166'468.00	0.03	a)
FR0013426368	1.1250 % ADPFP 1 1/8 06/18/34	0	200	0	200 EUR	71.71%	143'426.00	0.02	a)
FR0013428489	0.3750 % ENGIFP 0 3/8 06/21/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	86.91%	260'739.00	0.04	a)
FR0013428513	1.3750 % ENGIFP 1 3/8 06/21/39 EMTN	0	200	0	200 EUR	66.19%	132'388.00	0.02	a)
FR0013429073	0.6250 % BPCEGP 0 5/8 09/26/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.93%	284'784.00	0.05	a)
FR0013430535	1.1250 % INLIFP 1 1/8 07/02/29	0	200	0	200 EUR	82.98%	165'954.00	0.03	a)
FR0013430733	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 07/01/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.76%	179'510.00	0.03	a)
FR0013430741	0.6250 % LIFP 0 5/8 07/01/30 EMTN	100	200	0	300 EUR	77.94%	233'814.00	0.04	a)
FR0013431277	1.6250 % BNP 1 5/8 07/02/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	77.46%	232'389.00	0.04	a)
FR0013431715	1.7500 % ULFP 1 3/4 07/01/49 EMTN	200	0	0	200 EUR	62.64%	125'284.00	0.02	a)
FR0013432770	0.1250 % BFCM 0 1/8 02/05/24 EMTN	0	300	0	300 EUR	96.76%	290'265.00	0.05	a)
FR0013433596	0.2500 % FRLBP 0 1/4 07/12/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	88.43%	88'428.00	0.02	a)
FR0013434776	0.5000 % BNP 0 1/2 07/15/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.00%	190'000.00	0.03	a)
FR0013444304	0.1000 % HSBC 0.1 09/03/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	85.62%	256'872.00	0.04	a)
FR0013444536	0.0000 % DSYFP 0 09/16/24	200	0	0	200 EUR	94.42%	188'842.00	0.03	a)
FR0013444544	0.1250 % DSYFP 0 1/8 09/16/26	300	400	300	400 EUR	88.70%	354'808.00	0.06	a)
FR0013444551	0.3750 % DSYFP 0 3/8 09/16/29	300	0	0	300 EUR	82.11%	246'333.00	0.04	a)
FR0013444676	0.0000 % ORAFP 0 09/04/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.05%	176'102.00	0.03	a)
FR0013444684	0.5000 % ORAFP 0 1/2 09/04/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	73.68%	147'352.00	0.03	a)
FR0013444692	1.3750 % ORAFP 1 3/8 09/04/49 EMTN	0	200	0	200 EUR	64.90%	129'804.00	0.02	a)
FR0013444759	0.1250 % BNP 0 1/8 09/04/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.09%	264'273.00	0.05	a)
FR0013445137	0.0000 % RTEFRA 0 09/09/27 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013445152	1.1250 % RTEFRA 1 1/8 09/09/49 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013445335	1.6250 % VIEFP 1 5/8 PERP	200	400	200	400 EUR	87.38%	349'500.00	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR0013447166	1.1250 % STLA 1 1/8 09/18/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	84.33%	252'999.00	0.04	a)
FR0013447877	1.7500 % ORAFP 1 3/4 PERP EMTN	200	500	0	700 EUR	88.50%	619'500.00	0.11	a)
FR0013448032	0.2500 % WLNFP 0 1/4 09/18/24	200	0	0	200 EUR	94.42%	188'834.00	0.03	a)
FR0013448859	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 09/24/29 EMTN	100	100	0	200 EUR	80.27%	160'544.00	0.03	a)
FR0013450822	0.3750 % CMARK 0 3/8 10/03/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.77%	81'773.00	0.01	a)
FR0013452620	0.5000 % VIEFP 0 1/2 10/14/31 EMTN	100	300	100	300 EUR	76.54%	229'626.00	0.04	a)
FR0013453040	0.2500 % ALOFP 0 1/4 10/14/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.46%	178'914.00	0.03	a)
FR0013455540	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 02/24/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.53%	173'068.00	0.03	a)
FR0013455813	0.5000 % ENGIFP 0 1/2 10/24/30 EMTN	0	500	0	500 EUR	77.18%	385'880.00	0.07	a)
FR0013455821	1.2500 % ENGIFP 1 1/4 10/24/41	0	300	0	300 EUR	61.43%	184'290.00	0.03	a)
FR0013456449	0.8750 % RIFP 0 7/8 10/24/31	200	0	0	200 EUR	79.14%	158'274.00	0.03	a)
FR0013457058	0.5000 % ALSFR 0 1/2 10/30/34 EMTN	300	0	0	300 EUR	70.50%	211'491.00	0.04	a)
FR0013463650	0.1250 % EFFF 0 1/8 05/27/25 EMTN	0	500	0	500 EUR	93.06%	465'275.00	0.08	a)
FR0013463668	0.3750 % EFFF 0 3/8 11/27/27 EMTN	0	400	0	400 EUR	87.40%	349'588.00	0.06	a)
FR0013463676	0.7500 % EFFF 0 3/4 11/27/31	0	300	0	300 EUR	80.16%	240'489.00	0.04	a)
FR0013463775	2.0000 % CNPFP 2 07/27/50	200	0	0	200 EUR	82.25%	164'500.00	0.03	a)
FR0013464922	3.0000 % EDF 3 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013465358	0.5000 % BNP 0 1/2 06/04/26	200	0	0	200 EUR	92.28%	184'550.00	0.03	a)
FR0013465424	2.0000 % EDF 2 12/09/49 EMTN	300	100	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013476090	1.1250 % RENAUL 1 1/8 01/15/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	88.31%	176'628.00	0.03	a)
FR0013476199	0.2500 % BPCEGP 0 1/4 01/15/26	600	0	0	600 EUR	90.10%	540'606.00	0.09	a)
FR0013476207	0.6250 % BPCEGP 0 5/8 01/15/30	100	100	0	200 EUR	79.68%	159'352.00	0.03	a)
FR0013476553	0.7500 % BFCM 0 3/4 01/17/30	300	0	0	300 EUR	78.64%	235'932.00	0.04	a)
FR0013476595	0.6640 % VIEFP 0.664 01/15/31 EMTN	300	300	300	300 EUR	79.27%	237'798.00	0.04	a)
FR0013476611	1.1250 % BNP 1 1/8 01/15/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.75%	169'500.00	0.03	a)
FR0013479276	0.7500 % SOCGEN 0 3/4 01/25/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	87.55%	350'200.00	0.06	a)
FR0013482817	0.0000 % MCFP 0 02/11/24 EMTN	400	0	0	400 EUR	96.99%	387'976.00	0.07	a)
FR0013482825	0.0000 % MCFP 0 02/11/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	90.63%	362'512.00	0.06	a)
FR0013482833	0.1250 % MCFP 0 1/8 02/11/28	600	0	0	600 EUR	85.15%	510'912.00	0.09	a)
FR0013482841	0.3750 % MCFP 0 3/8 02/11/31	300	0	0	300 EUR	79.53%	238'590.00	0.04	a)
FR0013484458	0.5000 % BNP 0 1/2 02/19/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	85.50%	342'000.00	0.06	a)
FR0013486701	0.1250 % SOCGEN 0 1/8 02/24/26	300	0	0	300 EUR	89.36%	268'092.00	0.05	a)
FR0013494168	0.2500 % SUFP 0 1/4 03/11/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	83.32%	249'951.00	0.04	a)
FR0013495181	0.5710 % BNFP 0.571 03/17/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.77%	89'766.00	0.02	a)
FR0013504644	1.3750 % ENGIFP 1 3/8 03/27/25	0	500	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013504677	1.7500 % ENGIFP 1 3/4 03/27/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	90.58%	271'749.00	0.05	a)
FR0013505104	1.0000 % SANFP 1 04/01/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	95.12%	95'121.00	0.02	a)
FR0013505112	1.5000 % SANFP 1 1/2 04/01/30 EMTN	500	0	0	500 EUR	88.55%	442'760.00	0.08	a)
FR0013505260	2.6250 % CAFP 2 5/8 12/15/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.92%	284'769.00	0.05	a)
FR0013505542	1.2500 % VIEFP 1 1/4 04/02/27 EMTN	200	600	200	600 EUR	91.04%	546'240.00	0.09	a)
FR0013505625	2.1250 % ADPPF 2 1/8 10/02/26	200	0	0	200 EUR	94.42%	188'834.00	0.03	a)
FR0013505633	2.7500 % ADPPF 2 3/4 04/02/30	500	0	0	500 EUR	92.46%	462'290.00	0.08	a)
FR0013506300	1.6250 % ORAFP 1 5/8 04/07/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	83.53%	250'575.00	0.04	a)
FR0013506508	0.7500 % MCFP 0 3/4 04/07/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	94.77%	379'092.00	0.07	a)
FR0013506524	1.1250 % RIFP 1 1/8 04/07/25	300	0	0	300 EUR	94.83%	284'496.00	0.05	a)
FR0013506532	1.7500 % RIFP 1 3/4 04/08/30	300	0	0	300 EUR	88.20%	264'612.00	0.05	a)
FR0013506821	2.6250 % ULFP 2 5/8 04/09/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.11%	180'210.00	0.03	a)
FR0013506862	1.0000 % SUFP 1 04/09/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.67%	181'340.00	0.03	a)
FR0013507654	1.1250 % ENFP 1 1/8 07/24/28	300	0	0	300 EUR	88.33%	264'978.00	0.05	a)
FR0013507704	1.2500 % VIEFP 1 1/4 04/15/28 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013507852	1.6250 % CAPFP 1 5/8 04/15/26	200	0	0	200 EUR	93.85%	187'706.00	0.03	a)
FR0013507860	2.0000 % CAPFP 2 04/15/29	200	0	0	200 EUR	90.54%	181'072.00	0.03	a)
FR0013507878	2.3750 % CAPFP 2 3/8 04/15/32	400	0	0	400 EUR	88.44%	353'764.00	0.06	a)
FR0013508710	1.1250 % BNP 1 1/8 04/17/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	84.55%	253'662.00	0.04	a)
FR0013509098	1.1250 % SOCGEN 1 1/8 04/21/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.25%	186'500.00	0.03	a)
FR0013509627	2.0000 % DECFP 2 10/24/24	200	0	0	200 EUR	96.80%	193'602.00	0.03	a)
FR0013509643	2.6250 % DECFP 2 5/8 04/24/28	200	0	0	200 EUR	91.76%	183'526.00	0.03	a)
FR0013509726	0.6250 % BPCEGP 0 5/8 04/28/25	0	200	0	200 EUR	93.20%	186'402.00	0.03	a)
FR0013510179	2.8750 % ELOFR 2 7/8 01/29/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.83%	93'833.00	0.02	a)
FR0013511227	0.8750 % CMARK 0 7/8 05/07/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.87%	175'732.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR0013512407	0.7500 % KERFP 0 3/4 05/13/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.60%	175'204.00	0.03	a)
FR0013512449	1.2500 % VIEFP 1 1/4 05/14/35 EMTN	0	600	300	300 EUR	74.23%	222'681.00	0.04	a)
FR0013512621	1.0000 % DGFP 1 05/19/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	81.31%	243'933.00	0.04	a)
FR0013512944	2.7500 % STLA 2 3/4 05/15/26	500	0	0	500 EUR	96.73%	483'640.00	0.08	a)
FR0013513538	0.7500 % LRFP 0 3/4 05/20/30	200	0	0	200 EUR	83.23%	166'466.00	0.03	a)
FR0013515749	1.2500 % BFCM 1 1/4 06/03/30	300	0	0	300 EUR	80.92%	242'763.00	0.04	a)
FR0013516069	0.3750 % EFPF 0 3/8 01/05/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.23%	184'466.00	0.03	a)
FR0013516077	0.5000 % EFPF 0 1/2 06/05/28 EMTN	0	400	0	400 EUR	86.85%	347'408.00	0.06	a)
FR0013516184	1.6250 % ACAFP 1 5/8 06/05/30 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013517026	0.3950 % BNFP 0.395 06/10/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	82.98%	165'954.00	0.03	a)
FR0013517190	0.3750 % ENGF 0 3/8 06/11/27 EMTN	0	600	400	200 EUR	86.90%	173'798.00	0.03	a)
FR0013517307	1.2500 % CMARK 1 1/4 06/11/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.25%	170'500.00	0.03	a)
FR0013518024	0.5000 % FRLBP 0 1/2 06/17/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.38%	182'750.00	0.03	a)
FR0013518057	1.2500 % SOCGEN 1 1/4 06/12/30	400	0	0	400 EUR	80.30%	321'216.00	0.06	a)
FR0013519071	1.1250 % CAPFP 1 1/8 06/23/30	300	0	0	300 EUR	83.36%	250'077.00	0.04	a)
FR0013519261	2.1250 % LAMON 2 1/8 06/23/31	200	0	0	200 EUR	78.21%	156'422.00	0.03	a)
FR0013519279	1.6250 % COVFP 1 5/8 06/23/30	200	0	0	200 EUR	85.34%	170'678.00	0.03	a)
FR0013521267	2.0000 % ULFP 2 06/29/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.17%	162'340.00	0.03	a)
FR0013521564	0.8750 % WLNFP 0 7/8 06/30/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.91%	173'828.00	0.03	a)
FR0013521630	2.5000 % CNPFP 2 1/2 06/30/51 EMTN	100	100	0	200 EUR	81.75%	163'500.00	0.03	a)
FR0013522141	1.5000 % ADPFP 1 1/2 07/02/32	300	0	0	300 EUR	79.65%	238'959.00	0.04	a)
FR0013522695	0.6250 % RTEFRA 0 5/8 07/08/32 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013522703	1.1250 % RTEFRA 1 1/8 07/08/40 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013523602	2.0000 % ACAFP 2 07/17/30	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013524865	3.2500 % ELOFR 3 1/4 07/23/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.41%	277'227.00	0.05	a)
FR0013532280	0.5000 % BNP 0 1/2 09/01/28	0	200	0	200 EUR	83.88%	167'750.00	0.03	a)
FR0013533031	2.7500 % ORANOF 2 3/4 03/08/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	91.20%	182'400.00	0.03	a)
FR0013534278	0.1250 % ARFP 0 1/8 01/18/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	81.66%	244'983.00	0.04	a)
FR0013534336	3.3750 % EDF 3 3/8 PERP	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013534351	2.8750 % EDF 2 7/8 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013534484	0.1250 % ORAFP 0 1/8 09/16/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	79.90%	159'796.00	0.03	a)
FR0013534674	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 09/15/27 DMTN	300	0	0	300 EUR	86.75%	260'250.00	0.04	a)
FR0013535150	1.3750 % ICADFP 1 3/8 09/17/30	300	0	0	300 EUR	79.96%	239'865.00	0.04	a)
FR0013536661	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 09/22/28	200	100	0	300 EUR	85.63%	256'875.00	0.04	a)
FR00140003P3	0.1000 % BFCM 0.1 10/08/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	84.78%	84'784.00	0.01	a)
FR00140005C6	1.5000 % ETLFP 1 1/2 10/13/28	300	0	0	300 EUR	78.08%	234'249.00	0.04	a)
FR00140005J1	0.3750 % BNP 0 3/8 10/14/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.00%	174'000.00	0.03	a)
FR00140005L7	1.7500 % ORAFP 1 3/4 PERP EMTN	200	0	0	200 EUR	83.00%	166'000.00	0.03	a)
FR0014000774	0.7500 % LAMON 0 3/4 04/20/26	200	0	0	200 EUR	88.95%	177'900.00	0.03	a)
FR00140007J7	0.6250 % BFCM 0 5/8 02/21/31 EMTN	400	0	0	400 EUR	75.36%	301'440.00	0.05	a)
FR00140007K5	2.2500 % VIEFP 2 1/4 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR00140007L3	2.5000 % VIEFP 2 1/2 PERP	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014000D31	0.0000 % MLFP 0 11/02/28	0	100	0	100 EUR	82.48%	82'481.00	0.01	a)
FR0014000D49	0.2500 % MLFP 0 1/4 11/02/32	200	0	0	200 EUR	74.89%	149'780.00	0.03	a)
FR0014000KN6	0.2000 % IDFMOB 0.2 11/16/35 EMTN	200	0	0	200 EUR	65.71%	131'412.00	0.02	a)
FR0014000KT3	0.8750 % LIFP 0 7/8 02/17/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	77.31%	77'314.00	0.01	a)
FR0014000OZ2	1.0000 % SOCGEN 1 11/24/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.75%	266'250.00	0.05	a)
FR0014000UC8	0.6250 % ULFP 0 5/8 05/04/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.30%	172'598.00	0.03	a)
FR0014000UD6	1.3750 % ULFP 1 3/8 12/04/31 EMTN	400	0	0	400 EUR	77.82%	311'260.00	0.05	a)
FR0014000UL9	0.6250 % BNP 0 5/8 12/03/32 EMTN	500	0	0	500 EUR	70.62%	353'090.00	0.06	a)
FR0014000XY6	0.3750 % CNPFP 0 3/8 03/08/28	100	100	0	200 EUR	81.09%	162'170.00	0.03	a)
FR0014000Y93	0.1250 % ACAFP 0 1/8 12/09/27 EMTN	600	100	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014001EW8	0.0000 % ALOFP 0 01/11/29	300	0	0	300 EUR	79.76%	239'283.00	0.04	a)
FR0014001G29	0.0100 % BPCEGP 0.01 01/14/27	0	200	0	200 EUR	86.13%	172'264.00	0.03	a)
FR0014001G37	0.2500 % BPCEGP 0 1/4 01/14/31	300	100	0	400 EUR	74.73%	298'904.00	0.05	a)
FR0014001GA9	0.5000 % SOCGEN 0 1/2 06/12/29	300	0	0	300 EUR	81.00%	243'000.00	0.04	a)
FR0014001I68	0.2500 % BFCM 0 1/4 07/19/28	300	0	0	300 EUR	80.58%	241'725.00	0.04	a)
FR0014001IM0	0.6250 % ICADFP 0 5/8 01/18/31	200	0	0	200 EUR	74.25%	148'500.00	0.03	a)
FR0014001JP1	0.0000 % PSABFR 0 01/22/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.75%	185'504.00	0.03	a)
FR0014001JT3	0.5000 % BNP 0 1/2 01/19/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	79.00%	237'000.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR0014001R34	0.7500 % FRLBP 0 3/4 08/02/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	81.00%	162'000.00	0.03	a)
FR0014002B3	0.1250 % SOCGEN 0 1/8 02/18/28 EMTN	200	100	0	300 EUR	83.05%	249'138.00	0.04	a)
FR00140027U2	0.7500 % BPCEGP 0 3/4 03/03/31 EMTN	400	0	0	400 EUR	75.92%	303'676.00	0.05	a)
FR0014002BJ9	0.8750 % CMARK 0 7/8 03/11/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	73.23%	146'454.00	0.03	a)
FR0014002C30	0.0000 % VIEFP 0 06/09/26 EMTN	0	600	0	600 EUR	88.87%	533'214.00	0.09	a)
FR0014002NR7	0.0000 % ARVASL 0 09/30/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.89%	187'788.00	0.03	a)
FR0014002QE8	1.1250 % SOCGEN 1 1/8 06/30/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.50%	173'000.00	0.03	a)
FR0014002S57	0.0100 % BFCM 0.01 05/11/26 EMTN	200	200	0	400 EUR	88.18%	352'720.00	0.06	a)
FR0014002X43	0.2500 % BNP 0 1/4 04/13/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	87.75%	263'250.00	0.05	a)
FR0014003182	0.3750 % ACAFP 0 3/8 04/20/28 EMTN	600	100	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014003B55	1.3750 % ORAFP 1 3/8 PERP EMTN	0	100	0	100 EUR	79.50%	79'500.00	0.01	a)
FR0014003N69	0.3750 % AIFP 0 3/8 05/27/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	80.43%	80'432.00	0.01	a)
FR0014003OB7	0.9500 % IDFMOB 0.95 05/28/41 EMTN	100	0	0	100 EUR	63.30%	63'300.00	0.01	a)
FR0014003OC5	0.4000 % IDFMOB 0.4 05/28/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	79.17%	158'338.00	0.03	a)
FR0014003Q41	0.0000 % BNFP 0 12/01/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.00%	182'002.00	0.03	a)
FR0014003SA0	0.6250 % BFCM 0 5/8 11/03/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	81.45%	325'804.00	0.06	a)
FR0014003XZ7	2.1250 % MACIFS 2 1/8 06/21/52	300	0	0	300 EUR	69.75%	209'250.00	0.04	a)
FR0014003Y09	0.6250 % MACIFS 0 5/8 06/21/27	100	0	0	100 EUR	84.36%	84'363.00	0.01	a)
FR00140044X1	0.7500 % FRLBP 0 3/4 06/23/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	75.16%	150'320.00	0.03	a)
FR0014004750	0.2500 % BFCM 0 1/4 06/29/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	83.21%	83'214.00	0.01	a)
FR00140049A8	0.8750 % GFCFP 0 7/8 06/30/36 EMTN	200	0	0	200 EUR	68.37%	136'740.00	0.02	a)
FR00140049Z5	0.0000 % ORAFP 0 06/29/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	88.62%	177'244.00	0.03	a)
FR0014004A06	0.7500 % ORAFP 0 3/4 06/29/34 EMTN	300	0	0	300 EUR	70.99%	212'982.00	0.04	a)
FR0014004FR9	0.5000 % DGFP 0 1/2 01/09/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	76.70%	153'390.00	0.03	a)
FR0014004GE5	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 07/08/27 EMTN	200	100	0	300 EUR	85.44%	256'311.00	0.04	a)
FR0014004JA7	0.7500 % ALSFR 0 3/4 07/19/41 EMTN	0	300	0	300 EUR	59.63%	178'887.00	0.03	a)
FR0014004QI5	1.0000 % FMUFP 1 07/27/29	0	200	0	200 EUR	78.22%	156'438.00	0.03	a)
FR0014004QX4	0.1250 % ALOFP 0 1/8 07/27/27	100	0	0	100 EUR	86.73%	86'729.00	0.01	a)
FR0014004R72	0.5000 % ALOFP 0 1/2 07/27/30	200	0	0	200 EUR	77.42%	154'838.00	0.03	a)
FR00140057U9	0.8750 % BNP 0 7/8 08/31/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.63%	157'250.00	0.03	a)
FR0014005HY8	0.3750 % AIFP 0 3/8 09/20/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	73.00%	145'992.00	0.03	a)
FR0014005J14	0.5000 % ACAFP 0 1/2 09/21/29 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014005OK3	0.3750 % LRFP 0 3/8 10/06/31	0	100	0	100 EUR	78.10%	78'099.00	0.01	a)
FR0014005OL1	0.0000 % ARVASL 0 10/01/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.86%	179'710.00	0.03	a)
FR0014005RZ4	1.5000 % ACAFP 1 1/2 10/06/31	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014005SC1	0.1250 % RIFP 0 1/8 10/04/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	79.88%	159'768.00	0.03	a)
FR0014005SE7	0.3750 % ALSFR 0 3/8 10/05/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	78.09%	234'258.00	0.04	a)
FR0014005X99	1.8750 % CNFPF 1 7/8 10/12/53 EMTN	200	0	0	200 EUR	72.25%	144'500.00	0.02	a)
FR0014005ZP8	0.3750 % ENGIFP 0 3/8 10/26/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	80.02%	240'054.00	0.04	a)
FR0014005ZQ6	1.0000 % ENGIFP 1 10/26/36 EMTN	0	400	0	400 EUR	67.13%	268'520.00	0.05	a)
FR00140060E7	0.5000 % FLYFP 0 1/2 04/21/28	0	200	0	200 EUR	85.09%	170'172.00	0.03	a)
FR0014006144	1.8500 % BFCM 1.85 04/21/42	0	100	0	100 EUR	73.75%	73'750.00	0.01	a)
FR00140065E6	0.8750 % CMARK 0 7/8 10/25/31 EMTN	100	100	0	200 EUR	75.48%	150'954.00	0.03	a)
FR0014006CS9	0.5000 % ENFP 0 1/2 02/11/30	0	200	0	200 EUR	80.78%	161'568.00	0.03	a)
FR0014006FE2	0.5200 % BNFP 0.52 11/09/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.23%	160'466.00	0.03	a)
FR0014006IG1	1.0810 % CRLOG 1.081 02/15/34 EMTN	0	200	0	200 EUR	80.50%	161'000.00	0.03	a)
FR0014006IU2	0.1250 % SOCGEN 0 1/8 11/17/26	300	0	0	300 EUR	89.50%	268'500.00	0.05	a)
FR0014006IX6	2.0000 % VIEFP 2 PERP	0	400	100	300 EUR	83.25%	249'750.00	0.04	a)
FR0014006KD4	1.1250 % BFCM 1 1/8 11/19/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	72.28%	144'554.00	0.02	a)
FR0014006NI7	0.5000 % BNP 0 1/2 05/30/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	85.19%	255'576.00	0.04	a)
FR0014006PN2	0.6750 % IDFMOB 0.675 11/24/36 EMTN	200	0	0	200 EUR	68.14%	136'282.00	0.02	a)
FR0014006UO0	1.0000 % EDF 1 11/29/33 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014006XA3	0.6250 % SOCGEN 0 5/8 12/02/27	300	0	0	300 EUR	86.50%	259'500.00	0.04	a)
FR0014006XE5	0.0100 % BFCM 0.01 03/07/25 EMTN	300	200	0	500 EUR	92.39%	461'935.00	0.08	a)
FR0014006ZC4	0.6250 % ORAFP 0 5/8 12/16/33 EMTN	500	0	0	500 EUR	71.44%	357'200.00	0.06	a)
FR0014007LK5	0.8750 % BNP 0 7/8 07/11/30 EMTN	0	400	0	400 EUR	79.75%	319'000.00	0.05	a)
FR0014007LL3	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 01/14/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	85.63%	171'250.00	0.03	a)
FR0014007LM1	1.0000 % BPCEGP 1 01/14/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	75.77%	151'534.00	0.03	a)
FR0014007MK3	1.1250 % ACAFP 1 1/8 07/12/32 EMTN	200	100	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR0014007ML1	0.6250 % ACAFP 0 5/8 01/12/28	0	400	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014007PV3	0.6250 % BFCM 0 5/8 11/19/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	84.60%	253'806.00	0.04 a)	
FR0014007PW1	1.1250 % BFCM 1 1/8 01/19/32 EMTN	400	0	0	400 EUR	76.95%	307'784.00	0.05 a)	
FR0014007Q96	0.7500 % CMARK 0 3/4 01/18/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	79.52%	79'517.00	0.01 a)	
FR0014007VF4	0.3750 % BPCEGP 0 3/8 02/02/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	90.22%	180'444.00	0.03 a)	
FR0014007YA9	1.2500 % CNPFP 1 1/4 01/27/29	0	100	0	100 EUR	81.55%	81'546.00	0.01 a)	
FR00140084Y5	0.1250 % BPIFRA 0 1/8 11/25/28	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR00140087C4	1.0000 % FRLBP 1 02/09/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	86.75%	260'250.00	0.04 a)	
FR0014008CP1	1.2750 % IDFMOB 1.275 02/14/42 EMTN	0	200	0	200 EUR	66.35%	132'692.00	0.02 a)	
FR0014008CQ9	0.9500 % IDFMOB 0.95 02/16/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	81.38%	81'377.00	0.01 a)	
FR0014008FH1	0.8750 % ARVASL 0 7/8 02/17/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.81%	93'806.00	0.02 a)	
FR0014008MT2	1.1250 % ACAFP 1 1/8 02/24/29 EMTN	0	800	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014008PC1	2.2500 % BPCEGP 2 1/4 03/02/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	88.50%	88'500.00	0.02 a)	
FR0014008PK4	1.6250 % BPCEGP 1 5/8 03/02/29	0	200	0	200 EUR	87.00%	174'000.00	0.03 a)	
FR00140098S7	1.0000 % ACAFP 1 09/18/25 EMTN	0	600	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014009A50	1.0000 % BFCM 1 05/23/25 EMTN	0	300	0	300 EUR	93.83%	281'499.00	0.05 a)	
FR0014009DZ6	1.8750 % CAFP 1 7/8 10/30/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.38%	93'379.00	0.02 a)	
FR0014009E07	2.3750 % CAFP 2 3/8 10/30/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	90.35%	180'690.00	0.03 a)	
FR0014009EI0	0.3750 % ORFP 0 3/8 03/29/24	0	200	0	200 EUR	96.94%	193'886.00	0.03 a)	
FR0014009EJ8	0.8750 % ORFP 0 7/8 06/29/26	0	400	0	400 EUR	92.37%	369'460.00	0.06 a)	
FR0014009HA0	2.5000 % BNP 2 1/2 03/31/32 EMTN	0	500	0	500 EUR	89.13%	445'625.00	0.08 a)	
FR0014009KQ0	1.2500 % SANFP 1 1/4 04/06/29	0	200	0	200 EUR	88.33%	176'664.00	0.03 a)	
FR0014009L57	1.3750 % RIFF 1 3/8 04/07/29	0	200	0	200 EUR	87.68%	175'366.00	0.03 a)	
FR0014009LQ8	2.1000 % BNP 2.1 04/07/32 EMTN	0	500	0	500 EUR	82.95%	414'755.00	0.07 a)	
FR0014009N55	1.3750 % ALSFR 1 3/8 04/13/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	83.61%	167'214.00	0.03 a)	
FR0014009UQ9	2.5000 % ACAFP 2 1/2 04/22/34	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014009YC1	2.3750 % BPCEGP 2 3/8 04/26/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	87.31%	174'618.00	0.03 a)	
FR0014009YD9	1.7500 % BPCEGP 1 3/4 04/26/27 EMTN	0	400	0	400 EUR	91.74%	366'968.00	0.06 a)	
FR001400A3G4	2.6250 % BFCM 2 5/8 11/06/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	89.84%	179'674.00	0.03 a)	
FR001400A5M7	1.8750 % KERFP 1 7/8 05/05/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	90.22%	180'440.00	0.03 a)	
FR001400AF72	2.3750 % ORAFP 2 3/8 05/18/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	90.11%	90'111.00	0.02 a)	
FR001400AFL5	1.8750 % SUEZFP 1 7/8 05/24/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	91.88%	183'750.00	0.03 a)	
FR001400AFN1	2.3750 % SUEZFP 2 3/8 05/24/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	89.12%	178'234.00	0.03 a)	
FR001400AFO9	2.8750 % SUEZFP 2 7/8 05/24/34 EMTN	0	300	0	300 EUR	86.14%	258'426.00	0.04 a)	
FR001400AJX2	2.2500 % ENFP 2 1/4 06/29/29	0	100	0	100 EUR	91.69%	91'694.00	0.02 a)	
FR001400AJY0	3.2500 % ENFP 3 1/4 06/30/37	0	300	0	300 EUR	89.73%	269'199.00	0.05 a)	
FR001400AKP6	2.7500 % BNP 2 3/4 07/25/28 EMTN	0	500	0	500 EUR	93.06%	465'285.00	0.08 a)	
FR001400AO14	2.6250 % SOCGEN 2 5/8 05/30/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	92.95%	278'844.00	0.05 a)	
FR001400AOL7	1.8750 % ARRRFP 1 7/8 01/03/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	90.65%	181'306.00	0.03 a)	
FR001400AY79	3.8750 % BFCM 3 7/8 06/16/32	0	300	0	300 EUR	94.14%	282'414.00	0.05 a)	
FR001400BB83	2.1250 % OSEOFI 2 1/8 11/29/27 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400BDD5	3.3750 % ARVASL 3 3/8 01/04/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.58%	195'168.00	0.03 a)	
FR001400CEQ3	2.5000 % ACAFP 2 1/2 08/29/29 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400CFW8	3.6250 % BNP 3 5/8 09/01/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.69%	191'376.00	0.03 a)	
FR001400CH94	2.7500 % DGFP 2 3/4 09/02/32 EMTN	0	300	0	300 EUR	91.06%	273'168.00	0.05 a)	
FR001400CHQ6	2.0000 % OSEOFI 2 09/02/30	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400CJG3	3.0710 % BNFP 3.071 09/07/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.91%	191'812.00	0.03 a)	
FR001400CKA4	5.2500 % SOCGEN 5 1/4 09/06/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.38%	198'750.00	0.03 a)	
FR001400CKB2	2.8750 % SAGESS 2 7/8 09/07/32 EMTN	0	300	0	300 EUR	93.97%	281'898.00	0.05 a)	
FR001400CMY0	3.1250 % BFCM 3 1/8 09/14/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	96.50%	193'002.00	0.03 a)	
FR001400CMZ7	3.6250 % BFCM 3 5/8 09/14/32 EMTN	0	300	0	300 EUR	96.64%	289'920.00	0.05 a)	
FR001400CND2	2.8750 % AIFP 2 7/8 09/16/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	94.96%	189'924.00	0.03 a)	
FR001400CQ85	3.3750 % CMARK 3 3/8 09/19/27 EMTN	0	400	0	400 EUR	96.93%	387'720.00	0.07 a)	
FR001400CRG6	4.8750 % RENAUL 4 7/8 09/21/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.40%	301'194.00	0.05 a)	
FR001400CSG4	4.0000 % ARVASL 4 09/22/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	98.58%	197'158.00	0.03 a)	
FR001400CW12	3.1250 % ALSFR 3 1/8 09/28/37 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.22%	184'446.00	0.03 a)	
FR001400D0F9	4.1250 % CAFP 4 1/8 10/12/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.70%	201'394.00	0.03 a)	
FR001400D8K2	3.3750 % DGFP 3 3/8 10/17/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	96.24%	192'484.00	0.03 a)	
FR001400DAO4	5.3750 % ORANOF 5 3/8 05/15/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.86%	101'861.00	0.02 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR001400DL4	5.5000 % FRLBP 5 1/2 03/05/34	0	100	0	100 EUR	98.13%	98'125.00	0.02	a)
FR001400DNF5	5.3750 % ENFP 5 3/8 06/30/42	0	300	0	300 EUR	105.91%	317'724.00	0.05	a)
FR001400DNG3	4.6250 % ENFP 4 5/8 06/07/32	0	400	0	400 EUR	104.29%	417'176.00	0.07	a)
FR001400DOV0	3.2500 % RIFP 3 1/4 11/02/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	98.09%	196'174.00	0.03	a)
FR001400DP44	3.7500 % RIFP 3 3/4 11/02/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.83%	99'830.00	0.02	a)
FR001400DQ84	4.6250 % SUEZFP 4 5/8 11/03/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.37%	204'744.00	0.04	a)
FR001400DQ92	5.0000 % SUEZFP 5 11/03/32 EMTN	0	300	0	300 EUR	104.27%	312'807.00	0.05	a)
FR001400DT99	3.2500 % SUFP 3 1/4 11/09/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	98.82%	98'821.00	0.02	a)
FR001400DTA3	3.5000 % SUFP 3 1/2 11/09/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.43%	198'856.00	0.03	a)
FR001400DY43	3.6250 % ORAFP 3 5/8 11/16/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	98.82%	98'816.00	0.02	a)
FR001400DZM5	4.0000 % SOCGEN 4 11/16/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.11%	300'318.00	0.05	a)
FR001400DZN3	4.0000 % BFCM 4 11/21/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.02%	200'042.00	0.03	a)
FR001400DZO1	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 11/16/32 EMTN	0	400	0	400 EUR	100.30%	401'180.00	0.07	a)
FR001400E3H8	4.7500 % ARVASL 4 3/4 05/22/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.65%	203'290.00	0.04	a)
FR001400E797	4.0000 % BPCEGP 4 11/29/32 EMTN	0	400	0	400 EUR	98.26%	393'032.00	0.07	a)
FR001400EAY1	3.7500 % BFCM 3 3/4 02/01/33 EMTN	0	400	0	400 EUR	96.88%	387'536.00	0.07	a)
FR001400EHG3	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 12/06/30 EMTN	0	400	0	400 EUR	97.13%	388'500.00	0.07	a)
FR001400F075	4.3750 % BPCEGP 4 3/8 07/13/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.18%	99'176.00	0.02	a)
FR001400F083	4.5000 % BPCEGP 4 1/2 01/13/33 EMTN	0	300	0	300 EUR	98.47%	295'404.00	0.05	a)
FR001400F1G3	3.6250 % ENGIFP 3 5/8 01/11/30 EMTN	0	300	0	300 EUR	97.98%	293'943.00	0.05	a)
FR001400F620	5.2500 % CNPFP 5 1/4 07/18/53 EMTN	0	100	0	100 EUR	98.19%	98'187.00	0.02	a)
FR001400F703	3.1250 % SUFP 3 1/8 10/13/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.92%	195'842.00	0.03	a)
FR001400F711	3.3750 % SUFP 3 3/8 04/13/34 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.53%	97'531.00	0.02	a)
FR001400FB06	3.5000 % BPCEGP 3 1/2 01/25/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	97.42%	292'269.00	0.05	a)
FR001400FB22	5.1250 % BPCEGP 5 1/8 01/25/35 EMTN	0	400	0	400 EUR	97.14%	388'544.00	0.07	a)
IT0006729377	2.8000 % BACR 2.8 06/20/24 DMTN	200	0	0	200 EUR	98.23%	196'466.00	0.03	a)
PTCGDCOM0037	0.3750 % CXGD 0 3/8 09/21/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.69%	171'380.00	0.03	a)
PTCGDDOM0036	5.7500 % CXGD 5 3/4 10/31/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	103.05%	103'053.00	0.02	a)
PTEDPNOM0015	1.6250 % EDPL 1 5/8 04/15/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	91.65%	183'294.00	0.03	a)
PTGGDAOE0001	1.3750 % GALPNA 1 3/8 09/19/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0161488498	7.5000 % DT 7 1/2 01/24/33 EMTN	330	0	100	230 EUR	127.72%	293'746.80	0.05	a)
XS0162869076	5.8750 % TELEFO 5 7/8 02/14/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	115.16%	115'159.00	0.02	a)
XS0162990229	5.6250 % EDF 5 5/8 02/21/33 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0191154961	5.3750 % VATFAL 5 3/8 04/29/24 EMTN	150	0	0	150 EUR	101.98%	152'964.00	0.03	a)
XS0192503695	5.2500 % ENELIM 5 1/4 05/20/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	101.77%	203'532.00	0.04	a)
XS0193945655	5.8750 % ATOSTR 5 7/8 06/09/24 EMTN	0	300	0	300 EUR	102.09%	306'261.00	0.05	a)
XS0203712939	4.9000 % TRNIM 4.9 10/28/24	410	0	200	210 EUR	101.57%	213'301.20	0.04	a)
XS0207320242	4.8750 % ENBW 4 7/8 01/16/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	102.33%	102'333.00	0.02	a)
XS0222383027	4.0000 % GSK 4 06/16/25 EMTN	485	0	0	485 EUR	101.13%	490'461.10	0.08	a)
XS0229567440	4.1250 % GE 4 1/8 09/19/35 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0300113254	4.8750 % PG 4 7/8 05/11/27	307	0	0	307 EUR	105.39%	323'531.95	0.06	a)
XS0306646042	5.6250 % ENELIM 5 5/8 06/21/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	107.53%	430'136.00	0.07	a)
XS0418669429	5.1250 % TTEFP 5 1/8 03/26/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	101.78%	305'331.00	0.05	a)
XS0438844093	6.1250 % ENBW 6 1/8 07/07/39 EMTN	100	100	0	200 EUR	120.28%	240'556.00	0.04	a)
XS0452314536	5.1250 % ASSGEN 5 1/8 09/16/24 EMTN	670	0	0	670 EUR	102.16%	684'498.80	0.12	a)
XS0453133950	4.8750 % WMT 4 7/8 09/21/29	250	0	0	250 EUR	107.59%	268'982.50	0.05	a)
XS0503603267	4.8750 % DT 4 7/8 04/22/25 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0525602339	4.1250 % RABOBK 4 1/8 07/14/25	930	0	0	930 EUR	101.43%	943'299.00	0.16	a)
XS0545428285	3.8750 % TELIAS 3 7/8 10/01/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	100.19%	250'477.50	0.04	a)
XS0593606121	4.6250 % TENN 4 5/8 02/21/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0606704558	4.5000 % BNP 4 1/2 03/21/23 EMTN	420	0	420	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0617251995	5.1250 % ACAFP 5 1/8 04/18/23 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0746010908	3.6250 % TELIAS 3 5/8 02/14/24 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0758420748	3.5000 % HEIANA 3 1/2 03/19/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	100.02%	300'051.00	0.05	a)
XS0787786440	3.0000 % BHP 3 05/29/24 8	220	0	0	220 EUR	98.98%	217'762.60	0.04	a)
XS0811555183	2.8750 % HEIANA 2 7/8 08/04/25 EMTN	350	0	0	350 EUR	98.26%	343'906.50	0.06	a)
XS0826189028	3.0000 % TELIAS 3 09/07/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.76%	193'520.00	0.03	a)
XS0827999318	2.5000 % ORAFP 2 1/2 03/01/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0834371469	3.5000 % OMVAV 3 1/2 09/27/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	99.21%	297'642.00	0.05	a)
XS0834385923	3.2500 % BHP 3 1/4 09/24/27 10	150	0	0	150 EUR	97.00%	145'504.50	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
X50847580353	2.7500 % DT 2 3/4 10/24/24 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50857662448	2.3750 % MCD 2 3/8 11/27/24 GMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50860584308	3.6250 % MUBAUH 3 5/8 05/30/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50862442331	2.6250 % TELNO 2 5/8 12/06/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.85%	293'553.00	0.05	a)
X50862952297	2.8750 % DPWGR 2 7/8 12/11/24 EMTN	350	0	0	350 EUR	99.58%	348'526.50	0.06	a)
X50866310088	3.5500 % T 3.55 12/17/32	300	0	0	300 EUR	94.75%	284'244.00	0.05	a)
X50875797515	3.2500 % DT 3 1/4 01/17/28 EMTN	350	0	0	350 EUR	99.14%	346'986.50	0.06	a)
X50878743623	5.1250 % AXASA 5 1/8 07/04/43 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50895249620	2.8750 % BNP 2 7/8 09/26/23 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50897406814	4.2500 % ZURNVX 4 1/4 10/02/43 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50903136736	2.5000 % TLSAU 2 1/2 09/15/23 EMTN	220	0	220	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50903433513	2.5000 % T 2 1/2 03/15/23	320	0	320	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50907301260	2.8750 % WKLNA 2 7/8 03/21/23	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50909369489	3.1250 % CRHID 3 1/8 04/03/23	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50911388675	6.0000 % ACHMEA 6 04/04/43 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50922885362	2.6250 % MSFT 2 5/8 05/02/33	200	0	0	200 EUR	94.37%	188'734.00	0.03	a)
X50924998809	3.1250 % BHP 3 1/8 04/29/33 13	200	0	0	200 EUR	90.42%	180'844.00	0.03	a)
X50933241456	2.5000 % TELNO 2 1/2 05/22/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	97.11%	485'555.00	0.08	a)
X50933540527	2.3750 % RABOBK 2 3/8 05/22/23 EMTN	450	0	450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50934539726	2.6250 % RBOSGR 2 5/8 05/24/28	200	0	0	200 EUR	96.31%	192'628.00	0.03	a)
X50937858271	2.5000 % ABNAV 2 1/2 11/29/23 EMTN	450	0	450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50942082115	2.8750 % VGASDE 2 7/8 06/12/25 02	100	0	0	100 EUR	97.77%	97'765.00	0.02	a)
X50942094805	2.5000 % ESSITY 2 1/2 06/09/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50947658208	2.7500 % BACARD 2 3/4 07/03/23	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50951155869	3.1250 % VGASDE 3 1/8 07/10/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50951565091	3.2500 % ENIIM 3 1/4 07/10/23 EMTN	220	0	220	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50953564191	3.1250 % ACAFP 3 1/8 07/17/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50968972199	3.5000 % TELIAS 3 1/2 09/05/33 EMTN	250	0	0	250 EUR	96.23%	240'585.00	0.04	a)
X50969523843	3.2500 % SCGAU 3 1/4 09/11/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50969572204	2.8750 % EQNR 2 7/8 09/10/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	98.27%	196'540.00	0.03	a)
X50970852348	3.7500 % ENIIM 3 3/4 09/12/25 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50972530561	3.3750 % ASML 3 3/8 09/19/23	430	0	430	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50974122516	3.1250 % MELAIR 3 1/8 09/26/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50977496636	2.7500 % DPWGR 2 3/4 10/09/23 EMTN	270	0	270	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50981632804	6.0000 % RBAIV 6 10/16/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50986194883	4.0000 % ISPIM 4 10/30/23 EMTN	610	0	610	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50991099630	2.8750 % IBM 2 7/8 11/07/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.34%	295'014.00	0.05	a)
X50993148856	3.5000 % T 3 1/2 12/17/25	320	0	0	320 EUR	99.59%	318'672.00	0.05	a)
X50994991411	2.8750 % TTEFP 2 7/8 11/19/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.14%	196'288.00	0.03	a)
X50995643003	3.0000 % WPPLN 3 11/20/23 EMTN	240	0	240	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X50997775837	3.0000 % BFCM 3 11/28/23 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51001749289	3.1250 % MSFT 3 1/8 12/06/28	600	0	0	600 EUR	98.91%	593'442.00	0.10	a)
X51014610254	2.6250 % VW 2 5/8 01/15/24 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51015217703	2.6250 % BMW 2 5/8 01/17/24 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51017833242	2.5000 % BASGR 2 1/2 01/22/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51023703090	3.6250 % ENIIM 3 5/8 01/29/29 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51028421383	3.1250 % ACAFP 3 1/8 02/05/26 EMTN	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51028599287	5.2500 % ORAFP 5 1/4 PERP	250	0	0	250 EUR	100.00%	250'000.00	0.04	a)
X51028941117	1.8750 % MRK 1 7/8 10/15/26	250	0	0	250 EUR	94.45%	236'125.00	0.04	a)
X51028941893	2.5000 % MRK 2 1/2 10/15/34	250	0	0	250 EUR	90.65%	226'635.00	0.04	a)
X51028950290	4.5000 % NNGRNV 4 1/2 PERP	300	0	0	300 EUR	96.75%	290'250.00	0.05	a)
X51028952312	2.3750 % BXBAU 2 3/8 06/12/24	120	0	0	120 EUR	97.69%	117'224.40	0.02	a)
X51028954870	3.0000 % ITW 3 05/19/34	100	0	0	100 EUR	92.19%	92'187.00	0.02	a)
X51030851791	2.6250 % EFP 2 5/8 02/10/24 EMTN	0	400	0	400 EUR	99.34%	397'364.00	0.07	a)
X51032529205	3.3750 % ATIM 3 3/8 02/13/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	99.26%	198'518.00	0.03	a)
X51040506898	2.9720 % BPLN 2.972 02/27/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.31%	294'927.00	0.05	a)
X51041772986	2.3750 % DSM 2 3/8 04/03/24 EMTN	150	0	0	150 EUR	98.99%	148'491.00	0.03	a)
X51045553812	2.6250 % BFCM 2 5/8 03/18/24 EMTN	400	0	0	400 EUR	98.83%	395'304.00	0.07	a)
X51048428442	4.6250 % VW 4 5/8 PERP	500	0	0	500 EUR	94.88%	474'375.00	0.08	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1048519679	2.5000 % TTEFP 2 1/2 03/25/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	97.04%	388'168.00	0.07	a)
XS1048529041	2.5000 % RDSALN 2 1/2 03/24/26 EMTN	550	0	0	550 EUR	97.16%	534'374.50	0.09	a)
XS1050842423	3.7500 % GLENLN 3 3/4 04/01/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1052677892	3.2500 % AALLN 3 1/4 04/03/23 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1054522922	4.6250 % NNGRNV 4 5/8 04/08/44	150	0	0	150 EUR	98.63%	147'937.50	0.03	a)
XS1054534422	2.5500 % WMT 2.55 04/08/26	200	100	0	300 EUR	97.31%	291'942.00	0.05	a)
XS1061711575	4.0000 % AEGON 4 04/25/44 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.63%	195'250.00	0.03	a)
XS1061714165	2.6250 % PEP 2 5/8 04/28/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.99%	193'972.00	0.03	a)
XS1062493934	2.8750 % AON 2 7/8 05/14/26	320	0	0	320 EUR	94.75%	303'203.20	0.05	a)
XS1062900912	4.1250 % ASSGEN 4 1/8 05/04/26 EMTN	200	300	0	500 EUR	99.91%	499'540.00	0.09	a)
XS1068871448	2.3750 % BNP 2 3/8 05/20/24 EMTN	380	0	0	380 EUR	98.49%	374'246.80	0.06	a)
XS1068874970	2.3750 % C 2 3/8 05/22/24 EMTN	250	0	0	250 EUR	98.40%	246'010.00	0.04	a)
XS1069439740	3.8750 % AXASA 3 7/8 PERP EMTN	200	150	0	350 EUR	96.13%	336'437.50	0.06	a)
XS1069521083	2.3750 % ACAFP 2 3/8 05/20/24 EMTN	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1069539291	2.3750 % DGELN 2 3/8 05/20/26 EMTN	350	0	0	350 EUR	96.15%	336'507.50	0.06	a)
XS1069549761	3.0000 % BFCM 3 05/21/24 EMTN	280	0	0	280 EUR	98.57%	275'998.80	0.05	a)
XS1071713470	2.5000 % CARLB 2 1/2 05/28/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.37%	295'101.00	0.05	a)
XS1072516690	3.0000 % PLD 3 06/02/26	350	0	0	350 EUR	96.87%	339'027.50	0.06	a)
XS1074055770	2.5000 % ULFP 2 1/2 06/04/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.98%	237'455.00	0.04	a)
XS1074144871	2.8750 % GS 2 7/8 06/03/26 EMTN	205	0	0	205 EUR	97.69%	200'254.25	0.03	a)
XS1074208270	2.5000 % ENBW 2 1/2 06/04/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.14%	291'417.00	0.05	a)
XS1074382893	2.1250 % WFC 2 1/8 06/04/24 EMTN	0	750	250	500 EUR	97.92%	489'595.00	0.08	a)
XS1075218799	2.2500 % BACR 2 1/4 06/10/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.22%	196'448.00	0.03	a)
XS1076018131	2.4000 % T 2.4 03/15/24	360	0	0	360 EUR	98.57%	354'834.00	0.06	a)
XS1076018305	3.3750 % T 3 3/8 03/15/34	250	0	0	250 EUR	91.75%	229'370.00	0.04	a)
XS1076781589	4.3750 % NNGRNV 4 3/8 PERP EMTN	250	0	0	250 EUR	97.88%	244'687.50	0.04	a)
XS1077882394	2.7500 % ETISLT 2 3/4 06/18/26 GMTN	0	420	0	420 EUR	96.91%	407'034.60	0.07	a)
XS1079726334	2.3750 % BAC 2 3/8 06/19/24 EMTN	450	0	0	450 EUR	98.17%	441'751.50	0.08	a)
XS1080163964	2.5000 % SWFP 2 1/2 06/24/26	200	0	0	200 EUR	96.87%	193'738.00	0.03	a)
XS1083986718	3.8750 % AVLN 3 7/8 07/03/44 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.50%	243'750.00	0.04	a)
XS1084563615	1.7500 % RBOSGR 1 3/4 07/08/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.34%	194'670.00	0.03	a)
XS1087816374	2.2500 % SCGAU 2 1/4 07/16/24 EMTN	150	0	0	150 EUR	97.10%	145'651.50	0.03	a)
XS1087831688	2.6250 % ACEIM 2 5/8 07/15/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1088274672	3.0000 % FIREIT 3 07/16/24 EMTN	120	0	0	120 EUR	98.47%	118'164.00	0.02	a)
XS1091654761	2.3750 % IDSLN 2 3/8 07/29/24	200	0	0	200 EUR	97.05%	194'092.00	0.03	a)
XS1107727007	2.1250 % C 2 1/8 09/10/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.00%	282'012.00	0.05	a)
XS1109741329	2.5000 % CMCSA 2 1/2 09/15/26 EMTN	274	0	0	274 EUR	95.47%	261'587.80	0.05	a)
XS1109744778	1.8750 % TCLAU 1 7/8 09/16/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.03%	291'102.00	0.05	a)
XS1109802568	1.8750 % VOD 1 7/8 09/11/25 EMTN	450	0	0	450 EUR	95.49%	429'700.50	0.07	a)
XS1109950755	1.7500 % ZURNVX 1 3/4 09/16/24 EMTN	150	0	0	150 EUR	96.68%	145'012.50	0.02	a)
XS1111108673	2.2500 % HITTFP 2 1/4 03/24/25	300	0	0	300 EUR	95.92%	287'772.00	0.05	a)
XS1111559925	2.1250 % TTEFP 2 1/8 09/18/29 EMTN	500	0	0	500 EUR	90.41%	452'055.00	0.08	a)
XS1112013666	2.2500 % WPLN 2 1/4 09/22/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.39%	235'967.50	0.04	a)
XS1112678989	1.8750 % KO 1 7/8 09/22/26	300	0	0	300 EUR	93.89%	281'670.00	0.05	a)
XS1112829947	1.7500 % DGELN 1 3/4 09/23/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.15%	194'298.00	0.03	a)
XS1114473579	2.2130 % BPLN 2.213 09/25/26 EMTN	230	0	0	230 EUR	94.50%	217'343.10	0.04	a)
XS1116263325	2.1250 % GS 2 1/8 09/30/24 EMTN	274	0	0	274 EUR	97.49%	267'133.56	0.05	a)
XS1116408235	1.8750 % IBESM 1 7/8 10/08/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.34%	194'686.00	0.03	a)
XS1117286580	4.3750 % DANPEN 4 3/8 09/29/45	200	0	0	200 EUR	97.25%	194'500.00	0.03	a)
XS1117297785	1.2500 % BLK 1 1/4 05/06/25	300	250	300	250 EUR	95.22%	238'055.00	0.04	a)
XS1117298163	1.7500 % MCO 1 3/4 03/09/27	0	200	0	200 EUR	92.26%	184'524.00	0.03	a)
XS1120892507	2.9320 % TELEFO 2.932 10/17/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	95.37%	95'367.00	0.02	a)
XS1134519120	1.7500 % AKZANA 1 3/4 11/07/24 EMTN	200	100	200	100 EUR	97.29%	97'294.00	0.02	a)
XS1134541306	3.9410 % AXASA 3.941 PERP EMTN	250	0	0	250 EUR	96.88%	242'187.50	0.04	a)
XS1134729794	1.6250 % NOVNVX 1 5/8 11/09/26	100	0	0	100 EUR	93.35%	93'347.00	0.02	a)
XS1135277140	1.6250 % RDSALN 1 5/8 01/20/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	92.86%	371'444.00	0.06	a)
XS1135309794	1.2500 % BAYNGR 1 1/4 11/13/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1135337498	1.6250 % AAPL 1 5/8 11/10/26	680	500	680	500 EUR	93.58%	467'895.00	0.08	a)
XS1136406342	1.5000 % MMM 1 1/2 11/09/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.46%	277'368.00	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1138360166	2.1250 % WBA 2 1/8 11/20/26	200	100	0	300 EUR	92.20%	276'597.00	0.05	a)
XS1139315581	1.3750 % TTEFP 1 3/8 03/19/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	95.48%	381'936.00	0.07	a)
XS1140054526	2.2500 % BGRP 2 1/4 11/21/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	89.86%	224'660.00	0.04	a)
XS1140300663	1.5000 % VERAV 1 1/2 11/20/24	100	0	0	100 EUR	96.55%	96'548.00	0.02	a)
XS1140857316	3.1250 % STANLN 3 1/8 11/19/24 EMTN	120	0	0	120 EUR	98.38%	118'054.80	0.02	a)
XS1141969912	1.8750 % CMCSA 1 7/8 11/24/23 EMTN	233	0	233	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1143163183	1.2500 % IBM 1 1/4 05/26/23	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1144088165	2.6000 % T 2.6 12/17/29	100	100	0	200 EUR	91.17%	182'340.00	0.03	a)
XS1145750037	2.3750 % URENCO 2 3/8 12/02/24 EMTN	180	0	0	180 EUR	96.92%	174'452.40	0.03	a)
XS1147605791	1.3750 % GSK 1 3/8 12/02/24 EMTN	100	100	0	200 EUR	96.24%	192'486.00	0.03	a)
XS1148073205	2.2500 % REPSM 2 1/4 12/10/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.52%	189'046.00	0.03	a)
XS1150695192	4.8500 % VLVY 4.85 03/10/2078	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1152343668	3.3750 % MRKGR 3 3/8 12/12/2074	250	0	0	250 EUR	98.25%	245'625.00	0.04	a)
XS1166201035	1.2500 % BFCM 1 1/4 01/14/25 EMTN	600	0	0	600 EUR	94.95%	569'718.00	0.10	a)
XS1167204699	1.2500 % LLOYDS 1 1/4 01/13/25 EMTN	380	0	0	380 EUR	95.14%	361'543.40	0.06	a)
XS1167667283	1.6250 % VW 1 5/8 01/16/30 EMTN	280	0	0	280 EUR	86.16%	241'239.60	0.04	a)
XS1168962063	1.0000 % BMW 1 01/21/25 EMTN	500	0	100	400 EUR	95.57%	382'260.00	0.07	a)
XS1173792059	1.7500 % C 1 3/4 01/28/25	410	0	0	410 EUR	96.25%	394'620.90	0.07	a)
XS1176079843	1.9660 % ENELIM 1.966 01/27/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	96.79%	483'950.00	0.08	a)
XS1177459531	1.2500 % ENGS1 1 1/4 02/06/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.02%	190'048.00	0.03	a)
XS1179916017	1.2500 % CAF1 1 1/4 06/03/25 EMTN	210	0	0	210 EUR	94.40%	198'246.30	0.03	a)
XS1180130939	1.3750 % RABOBK 1 3/8 02/03/27 GMTN	500	0	0	500 EUR	91.71%	458'540.00	0.08	a)
XS1180256528	1.7500 % MS 1 3/4 01/30/25 GMTN	0	500	0	500 EUR	96.28%	481'375.00	0.08	a)
XS1180451657	1.5000 % ENIIM 1 1/2 02/02/26 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1180651587	4.2500 % ACHMEA 4 1/4 PERP EMTN	300	0	0	300 EUR	97.50%	292'500.00	0.05	a)
XS1185941850	2.6250 % SPPEUS 2 5/8 02/12/25	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1186176571	1.5000 % HTHROW 1 1/2 02/11/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	82.20%	164'394.00	0.03	a)
XS1189263400	1.1250 % NDASS 1 1/8 02/12/25 EMTN	450	0	0	450 EUR	95.34%	429'043.50	0.07	a)
XS1189286286	2.5000 % RENEPL 2 1/2 02/12/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.73%	195'452.00	0.03	a)
XS1190624038	1.2500 % EQNR 1 1/4 02/17/27 EMTN	0	400	100	300 EUR	90.75%	272'256.00	0.05	a)
XS1190624202	1.6250 % EQNR 1 5/8 02/17/35 EMTN	0	300	0	300 EUR	79.33%	237'993.00	0.04	a)
XS1190632999	2.3750 % BNP 2 3/8 02/17/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	96.58%	386'308.00	0.07	a)
XS1190973559	1.1090 % BPLN 1.109 02/16/23 EMTN	310	0	310	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1190974011	1.5730 % BPLN 1.573 02/16/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	91.27%	365'092.00	0.06	a)
XS1195056079	0.8750 % ROSW 0 7/8 02/25/25 EMTN	300	300	250	350 EUR	95.63%	334'708.50	0.06	a)
XS1195202822	2.6250 % TTEFP 2 5/8 PERP EMTN	750	0	0	750 EUR	94.13%	705'937.50	0.12	a)
XS1195574881	2.6250 % SOCGEN 2 5/8 02/27/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	96.95%	387'808.00	0.07	a)
XS1196373507	1.3000 % T 1.3 09/05/23	550	0	550	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1196380031	2.4500 % T 2.45 03/15/35	350	0	0	350 EUR	81.63%	285'712.00	0.05	a)
XS1196797614	1.2500 % NWIDE 1 1/4 03/03/25 EMTN	620	0	0	620 EUR	95.30%	590'829.00	0.10	a)
XS1197270819	1.6250 % MDLZ 1 5/8 03/08/27	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1197775692	1.5000 % APTV 1 1/2 03/10/25	150	0	0	150 EUR	95.18%	142'771.50	0.02	a)
XS1197833053	1.1250 % KO 1 1/8 03/09/27	500	0	0	500 EUR	90.50%	452'500.00	0.08	a)
XS1197833137	1.6250 % KO 1 5/8 03/09/35	550	0	0	550 EUR	79.00%	434'494.50	0.07	a)
XS1199356954	1.2500 % K 1 1/4 03/10/25	250	0	0	250 EUR	95.08%	237'697.50	0.04	a)
XS1199954691	1.2500 % SYNNVX 1 1/4 09/10/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.26%	170'516.00	0.03	a)
XS1201001572	2.5000 % SANTAN 2 1/2 03/18/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	96.62%	386'492.00	0.07	a)
XS1202849086	1.7500 % GLENLN 1 3/4 03/17/25 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1203941775	1.5000 % MEOGR 1 1/2 03/19/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.97%	278'898.00	0.05	a)
XS1204154410	2.6250 % ACAFP 2 5/8 03/17/27	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1205548164	1.6250 % WPPLN 1 5/8 03/23/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	86.07%	215'177.50	0.04	a)
XS1205616698	2.0000 % APAAU 2 03/22/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	91.73%	183'458.00	0.03	a)
XS1205618470	3.0000 % VATFAL 3 03/19/2077	300	0	0	300 EUR	91.13%	273'375.00	0.05	a)
XS1206411230	1.8750 % CCEP 1 7/8 03/18/30	370	0	0	370 EUR	87.40%	323'394.80	0.06	a)
XS1206541366	3.5000 % VW 3 1/2 PERP	450	0	0	450 EUR	82.88%	372'937.50	0.06	a)
XS1207005023	1.5000 % STATK 1 1/2 03/26/30 EMTN	150	0	0	150 EUR	87.13%	130'698.00	0.02	a)
XS1207058733	4.5000 % REPSM 4 1/2 03/25/2075	0	200	0	200 EUR	97.13%	194'250.00	0.03	a)
XS1209031019	2.6000 % SRENVX 2.6 PERP	200	0	0	200 EUR	92.38%	184'750.00	0.03	a)
XS1209863254	1.3750 % BAC 1 3/8 03/26/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.50%	286'503.00	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1215181980	1.0000 % DSM 1 04/09/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.63%	94'630.00	0.02	a)
XS1218319702	1.0000 % ULFP 1 03/14/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.10%	188'206.00	0.03	a)
XS1218363270	1.3750 % ULFP 1 3/8 04/15/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.81%	163'618.00	0.03	a)
XS1218821756	1.0000 % ABNANV 1 04/16/25 EMTN	540	0	0	540 EUR	95.09%	513'469.80	0.09	a)
XS1219462543	1.1250 % REESM 1 1/8 04/24/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.85%	189'702.00	0.03	a)
XS1222590488	2.0000 % EDPPL 2 04/22/25 EMTN	270	0	0	270 EUR	96.93%	261'702.90	0.05	a)
XS1223830677	1.0000 % GIS 1 04/27/23	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1224955408	1.5000 % BHP 1 1/2 04/29/30 17	150	0	0	150 EUR	83.63%	125'448.00	0.02	a)
XS1225626461	1.2500 % SMINLN 1 1/4 04/28/23	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1226748439	1.0000 % BMV 1 05/15/25	200	0	0	200 EUR	94.36%	188'712.00	0.03	a)
XS1226748512	1.7500 % BMV 1 3/4 05/15/35	100	100	0	200 EUR	82.32%	164'644.00	0.03	a)
XS1231027464	1.3000 % RELLN 1.3 05/12/25	200	0	0	200 EUR	94.74%	189'470.00	0.03	a)
XS1234370127	0.9500 % MMM 0.95 05/15/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1234373733	1.7500 % MMM 1 3/4 05/15/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.30%	264'900.00	0.05	a)
XS1234953906	2.1250 % ITW 2 1/8 05/22/30	200	0	0	200 EUR	90.23%	180'464.00	0.03	a)
XS1237271421	1.8750 % MCD 1 7/8 05/26/27 GMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1239502328	2.0000 % TCLAU 2 08/28/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.43%	95'430.00	0.02	a)
XS1239586594	2.1250 % ESBIRE 2 1/8 06/08/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	92.97%	232'430.00	0.04	a)
XS1240751062	1.6250 % LLY 1 5/8 06/02/26	200	0	0	200 EUR	93.65%	187'298.00	0.03	a)
XS1240751229	2.1250 % LLY 2 1/8 06/03/30	250	0	0	250 EUR	91.14%	227'850.00	0.04	a)
XS1241577490	1.0000 % UNANA 1 06/03/23 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1241581096	1.7500 % TENN 1 3/4 06/04/27 EMTN	150	0	0	150 EUR	93.14%	139'713.00	0.02	a)
XS1242413679	3.3750 % AVLN 3 3/8 12/04/45 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.32%	235'810.00	0.04	a)
XS1245292807	4.3750 % SLHNVX 4 3/8 PERP	200	0	0	200 EUR	96.88%	193'750.00	0.03	a)
XS1246732249	3.6250 % LBBW 3 5/8 06/16/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.28%	194'566.00	0.03	a)
XS1249493948	1.7500 % ADM 1 3/4 06/23/23	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1253558388	2.0000 % KHC 2 06/30/23	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1254428896	3.0000 % HSBC 3 06/30/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	97.08%	485'420.00	0.08	a)
XS1255433754	2.6250 % ECL 2 5/8 07/08/25	290	0	0	290 EUR	97.29%	282'141.00	0.05	a)
XS1265805090	2.0000 % GS 2 07/27/23 EMTN	594	0	594	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1288849471	2.3750 % KYGID 2 3/8 09/10/25	200	0	0	200 EUR	97.22%	194'442.00	0.03	a)
XS1288858548	3.0000 % BFCM 3 09/11/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.19%	194'376.00	0.03	a)
XS1288894691	1.7500 % SCMNFX 1 3/4 09/15/25	200	0	0	200 EUR	95.35%	190'708.00	0.03	a)
XS1291004270	1.7500 % IBESM 1 3/4 09/17/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1292352843	2.3840 % ESTONE 2.384 09/22/23	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1292384960	1.3750 % AAPL 1 3/8 01/17/24	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1292389415	2.0000 % AAPL 2 09/17/27	350	300	350	300 EUR	93.99%	281'955.00	0.05	a)
XS1292468045	1.8750 % RDSALN 1 7/8 09/15/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	95.95%	239'872.50	0.04	a)
XS1292988984	1.7500 % ENIIM 1 3/4 01/18/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1293505639	5.1250 % ASRNED 5 1/8 09/29/45	200	0	0	200 EUR	99.00%	198'000.00	0.03	a)
XS1293571425	1.5000 % STATK 1 1/2 09/21/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1294343337	6.2500 % OMVAV 6 1/4 PERP	200	0	0	200 EUR	103.63%	207'250.00	0.04	a)
XS1307369717	1.5000 % ENEXIS 1 1/2 10/20/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1310934382	2.0000 % WFC 2 04/27/26 EMTN	0	900	200	700 EUR	94.15%	659'043.00	0.11	a)
XS1311440082	5.5000 % ASSGEN 5 1/2 10/27/47 EMTN	400	0	0	400 EUR	100.38%	401'500.00	0.07	a)
XS1314318301	1.1250 % PG 1 1/8 11/02/23	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1315101011	1.6250 % EUROGR 1 5/8 11/03/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1316569638	1.8750 % ATOSTR 1 7/8 11/04/25 EMTN	0	130	0	130 EUR	93.36%	121'365.40	0.02	a)
XS1319652902	0.7500 % NESNVX 0 3/4 05/16/23 EMTN	200	300	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1319820541	1.6250 % FDX 1 5/8 01/11/27	0	400	0	400 EUR	91.82%	367'296.00	0.06	a)
XS1321424670	2.2500 % CMCSA 2 1/4 11/17/25 GMTN	196	0	0	196 EUR	95.96%	188'087.48	0.03	a)
XS1323463726	1.6250 % UPS 1 5/8 11/15/25	200	0	0	200 EUR	95.02%	190'032.00	0.03	a)
XS1323910684	1.9000 % MGCN 1.9 11/24/23	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1325645825	2.7500 % BNP 2 3/4 01/27/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.64%	191'274.00	0.03	a)
XS1326311070	2.3750 % EDPPL 2 3/8 11/27/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1327028459	2.1000 % MA 2.1 12/01/27	300	0	0	300 EUR	93.63%	280'896.00	0.05	a)
XS1327504087	1.7500 % ATOSTR 1 3/4 06/26/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	91.15%	182'308.00	0.03	a)
XS1328173080	1.8750 % CRHID 1 7/8 01/09/24 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1346115295	1.6250 % BFCM 1 5/8 01/19/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	93.48%	373'936.00	0.06	a)
XS1346228577	3.3750 % AXASA 3 3/8 07/06/47 EMTN	400	0	0	400 EUR	93.50%	374'000.00	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1362373224	3.0000 % GS 3 02/12/31 EMTN	200	100	0	300 EUR	91.34%	274'011.00	0.05	a)
XS1368470156	1.0000 % NDASS 1 02/22/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1369250755	1.6250 % BNP 1 5/8 02/23/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.30%	282'909.00	0.05	a)
XS1371715118	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/27/23 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1372839214	2.2000 % VOD 2.2 08/25/26 EMTN	650	0	0	650 EUR	95.10%	618'130.50	0.11	a)
XS1374865555	2.0000 % UCGIM 2 03/04/23 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1375841233	1.1250 % IBM 1 1/8 09/06/24	200	0	0	200 EUR	96.15%	192'294.00	0.03	a)
XS1375955678	1.7500 % IBM 1 3/4 03/07/28	200	0	0	200 EUR	90.72%	181'436.00	0.03	a)
XS1375957294	1.9530 % BPLN 1.953 03/03/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.39%	192'780.00	0.03	a)
XS1376614118	1.3750 % ULFP 1 3/8 03/09/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.09%	276'270.00	0.05	a)
XS1377679961	1.7500 % BRITEL 1 3/4 03/10/26 EMTN	500	0	0	500 EUR	94.21%	471'045.00	0.08	a)
XS1377681272	1.1250 % BRITEL 1 1/8 03/10/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1377682676	1.8750 % CCHLN 1 7/8 11/11/24 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1377745937	1.7500 % COVEGR 1 3/4 09/25/24 DIP	200	0	0	200 EUR	97.07%	194'142.00	0.03	a)
XS1378780891	2.2500 % XYL 2 1/4 03/11/23	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1378880253	2.8750 % BNP 2 7/8 10/01/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.39%	190'786.00	0.03	a)
XS1379122101	1.5000 % AMXLMM 1 1/2 03/10/24	0	450	0	450 EUR	97.59%	439'150.50	0.08	a)
XS1379184473	2.5000 % HSBC 2 1/2 03/15/27 EMTN	350	0	0	350 EUR	94.09%	329'311.50	0.06	a)
XS1382368113	2.5000 % NWG 2 1/2 03/22/23 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1382784509	1.2500 % RABOBK 1 1/4 03/23/26 GMTN	704	0	0	704 EUR	93.38%	657'374.08	0.11	a)
XS1382791975	1.5000 % DT 1 1/2 04/03/28 EMTN	450	0	0	450 EUR	90.30%	406'345.50	0.07	a)
XS1382792197	0.6250 % DT 0 5/8 04/03/23 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1383389670	1.3750 % SCGAU 1 3/8 03/22/23 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1384064587	3.2500 % SANTAN 3 1/4 04/04/26 DIP	300	0	0	300 EUR	96.07%	288'195.00	0.05	a)
XS1384281090	1.3750 % RELLN 1 3/8 05/12/26	250	0	0	250 EUR	93.18%	232'955.00	0.04	a)
XS1385945131	2.3750 % BFCM 2 3/8 03/24/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.30%	282'903.00	0.05	a)
XS1388625425	3.7500 % STLA 3 3/4 03/29/24 GMTN	250	100	0	350 EUR	99.95%	349'818.00	0.06	a)
XS1391086987	2.0000 % CKHH 2 04/06/28 B	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1391625289	1.1250 % AKZANA 1 1/8 04/08/26 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1392459381	1.5000 % CS 1 1/2 04/10/26 EMTN	450	400	450	400 EUR	87.82%	351'272.00	0.06	a)
XS1394764689	1.4600 % TELEFO 1.46 04/13/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.78%	187'568.00	0.03	a)
XS1395010397	1.5000 % MNDILN 1 1/2 04/15/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.19%	194'370.00	0.03	a)
XS1395021089	1.2500 % ACAFP 1 1/4 04/14/26 EMTN	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1395057430	1.1250 % TLSAU 1 1/8 04/14/26 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1395060491	1.0000 % REESM 1 04/21/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.55%	185'098.00	0.03	a)
XS1395180802	2.6250 % DLR 2 5/8 04/15/24	200	0	0	200 EUR	97.44%	194'880.00	0.03	a)
XS1396261338	0.7500 % BMW 0 3/4 04/15/24 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.13%	97'126.00	0.02	a)
XS1396285279	1.5000 % EUROGR 1 1/2 04/18/28 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1396367911	0.8750 % ENEXIS 0 7/8 04/28/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	91.72%	275'145.00	0.05	a)
XS1396767854	1.2500 % NTGYSM 1 1/4 04/19/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	92.27%	369'088.00	0.06	a)
XS1398476793	1.1250 % IBESM 1 1/8 04/21/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	93.20%	372'816.00	0.06	a)
XS1400169931	1.3750 % WFC 1 3/8 10/26/26 EMTN	0	900	200	700 EUR	90.90%	636'307.00	0.11	a)
XS1401174633	1.0000 % HEIANA 1 05/04/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.86%	91'856.00	0.02	a)
XS1401196958	1.1250 % ULFP 1 1/8 04/28/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.84%	175'676.00	0.03	a)
XS1401197253	2.0000 % ULFP 2 04/28/36 EMTN	200	0	0	200 EUR	77.59%	155'174.00	0.03	a)
XS1401331753	0.7500 % CAFP 0 3/4 04/26/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.60%	193'192.00	0.03	a)
XS1402177601	1.7500 % CHGRID 1 3/4 05/19/25 REGS	150	0	0	150 EUR	94.27%	141'403.50	0.02	a)
XS1402941790	0.6250 % ABBNVX 0 5/8 05/03/23 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1403015156	1.1250 % UNANA 1 1/8 04/29/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.48%	176'954.00	0.03	a)
XS1403264291	1.7500 % MCD 1 3/4 05/03/28 GMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1403264374	1.0000 % MCD 1 11/15/23 GMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1403388694	1.3750 % ENGSM 1 3/8 05/05/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.22%	180'444.00	0.03	a)
XS1403499848	2.7500 % LIBMUT 2 3/4 05/04/26 REGS	250	0	0	250 EUR	95.36%	238'402.50	0.04	a)
XS1405762805	1.5000 % TKAHV 1 1/2 12/07/26	100	100	0	200 EUR	92.03%	184'050.00	0.03	a)
XS1405765733	1.2500 % DOV 1 1/4 11/09/26	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1405767515	1.0000 % UPS 1 11/15/28	150	0	0	150 EUR	86.29%	129'436.50	0.02	a)
XS1405777316	1.8500 % BG 1.85 06/16/23	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1405780617	1.8750 % PKI 1 7/8 07/19/26	200	0	0	200 EUR	92.07%	184'144.00	0.03	a)
XS1405780963	1.3750 % ASML 1 3/8 07/07/26	300	0	0	300 EUR	93.39%	280'164.00	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1405782407	1.5000 % KHC 1 1/2 05/24/24	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1405784015	2.2500 % KHC 2 1/4 05/25/28	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1405816312	1.8750 % ATDBCN 1 7/8 05/06/26	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1408317433	1.0000 % ORAFP 1 05/12/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.30%	188'590.00	0.03	a)
XS1409362784	1.6150 % F 1.615 05/11/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1410417544	1.0000 % K 1 05/17/24	250	0	0	250 EUR	96.77%	241'925.00	0.04	a)
XS1410426024	1.1250 % AXASA 1 1/8 05/15/28 EMTN	100	100	0	200 EUR	88.32%	176'638.00	0.03	a)
XS1411401083	1.2500 % RDSALN 1 1/4 05/12/28 EMTN	520	0	0	520 EUR	88.10%	458'099.20	0.08	a)
XS1411404426	1.2500 % AZN 1 1/4 05/12/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	88.66%	221'660.00	0.04	a)
XS1411404855	0.7500 % AZN 0 3/4 05/12/24 EMTN	250	0	0	250 EUR	96.76%	241'890.00	0.04	a)
XS1411405662	0.7500 % RDSALN 0 3/4 05/12/24 EMTN	150	0	0	150 EUR	96.70%	145'048.50	0.02	a)
XS1411535799	0.6500 % JNJ 0.65 05/20/24	250	0	0	250 EUR	96.78%	241'952.50	0.04	a)
XS1412266816	1.1500 % JNJ 1.15 11/20/28	150	0	0	150 EUR	88.31%	132'460.50	0.02	a)
XS1412266907	1.6500 % JNJ 1.65 05/20/35	600	0	0	600 EUR	82.80%	496'824.00	0.09	a)
XS1412281534	1.2500 % SPG 1 1/4 05/13/25	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1412417617	1.2500 % NAB 1 1/4 05/18/26 GMTN	300	0	0	300 EUR	93.35%	280'056.00	0.05	a)
XS1412711217	1.6250 % ENIIM 1 5/8 05/17/28 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1415535340	1.1250 % CCEP 1 1/8 05/26/24	150	0	0	150 EUR	96.79%	145'177.50	0.03	a)
XS1415535696	1.7500 % CCEP 1 3/4 05/26/28	150	0	0	150 EUR	89.82%	134'730.00	0.02	a)
XS1418786890	0.7500 % SOCGEN 0 3/4 05/26/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1418788599	3.1250 % AZJAU 3 1/8 06/01/26 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1418788755	3.5000 % ZURNVX 3 1/2 10/01/46 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.88%	237'187.50	0.04	a)
XS1419646317	1.5000 % BNP 1 1/2 05/25/28 EMTN	650	0	0	650 EUR	88.69%	576'452.50	0.10	a)
XS1419674525	1.5540 % DAAFIN 1.554 06/07/28	100	0	0	100 EUR	88.97%	88'969.00	0.02	a)
XS1421827269	1.3750 % SRENVX 1 3/8 05/27/23	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1424730973	0.7500 % DANBNK 0 3/4 06/02/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1425966287	1.3750 % ENELIM 1 3/8 06/01/26	400	0	0	400 EUR	92.77%	371'064.00	0.06	a)
XS1428769738	1.0000 % CS 1 06/07/23 EMTN	450	0	450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1428773763	5.0000 % ASSGEN 5 06/08/48 EMTN	250	0	0	250 EUR	99.13%	247'812.50	0.04	a)
XS1428782160	1.8750 % ESBIRE 1 7/8 06/14/31 EMTN	250	0	0	250 EUR	85.45%	213'632.50	0.04	a)
XS1428953407	3.1250 % HSBC 3 1/8 06/07/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.40%	277'197.00	0.05	a)
XS1432384409	1.8750 % TENN 1 7/8 06/13/36 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.17%	81'170.00	0.01	a)
XS1432384664	1.0000 % TENN 1 06/13/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.34%	184'686.00	0.03	a)
XS1434170426	1.2500 % SYY 1 1/4 06/23/23	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1435229460	3.6250 % PVH 3 5/8 07/15/24 REGS	200	100	200	100 EUR	99.02%	99'021.00	0.02	a)
XS1440976535	1.2500 % TAP 1 1/4 07/15/24	250	0	0	250 EUR	96.32%	240'800.00	0.04	a)
XS1443997223	0.2500 % TTEFP 0 1/4 07/12/23 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1443997819	0.7500 % TTEFP 0 3/4 07/12/28 EMTN	500	0	0	500 EUR	85.45%	427'255.00	0.07	a)
XS1446746189	0.8750 % PEP 0 7/8 07/18/28	200	0	0	200 EUR	86.21%	172'428.00	0.03	a)
XS1457608013	0.7500 % C 0 3/4 10/26/23 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1457608286	1.5000 % C 1 1/2 10/26/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	86.29%	258'864.00	0.04	a)
XS1458405898	0.7500 % BAC 0 3/4 07/26/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1458408561	1.6250 % GS 1 5/8 07/27/26 EMTN	608	0	0	608 EUR	92.98%	565'336.64	0.10	a)
XS1463043973	1.0000 % WFC 1 02/02/27 EMTN	0	500	0	500 EUR	88.90%	444'520.00	0.08	a)
XS1463101680	1.6000 % VOD 1.6 07/29/31 EMTN	350	0	0	350 EUR	83.14%	291'000.50	0.05	a)
XS1470601656	2.2500 % BNP 2 1/4 01/11/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	92.54%	231'355.00	0.04	a)
XS1471646965	1.1250 % EDPL 1 1/8 02/12/24 EMTN	300	0	200	100 EUR	97.77%	97'773.00	0.02	a)
XS1476654238	0.3750 % RDSALN 0 3/8 02/15/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	93.89%	234'717.50	0.04	a)
XS1476654584	0.7500 % RDSALN 0 3/4 08/15/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	85.36%	213'387.50	0.04	a)
XS1482736185	0.6250 % ATCOA 0 5/8 08/30/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.66%	181'328.00	0.03	a)
XS1485532896	0.6250 % KPN 0 5/8 04/09/25 GMTN	200	0	0	200 EUR	93.72%	187'434.00	0.03	a)
XS1485533431	1.1250 % KPN 1 1/8 09/11/28 GMTN	200	0	0	200 EUR	86.69%	173'388.00	0.03	a)
XS1485597329	0.8750 % HSBC 0 7/8 09/06/24	700	250	0	950 EUR	95.63%	908'466.00	0.16	a)
XS1485603747	1.6000 % APTV 1.6 09/15/28	170	0	0	170 EUR	87.77%	149'207.30	0.03	a)
XS1485643610	1.1000 % KO 1.1 09/02/36	200	0	0	200 EUR	71.21%	142'414.00	0.02	a)
XS1485748393	0.9550 % GM 0.955 09/07/23 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1487315860	1.1250 % SANUK 1 1/8 09/08/23	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1488494987	1.0000 % HEMSOF 1 09/09/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.26%	176'518.00	0.03	a)
XS1489184900	1.8750 % GLENLN 1 7/8 09/13/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1489391109	1.2500 % PRE 1 1/4 09/15/26	250	0	0	250 EUR	90.20%	225'497.50	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1490726590	0.3750 % IBESM 0 3/8 09/15/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.53%	92'531.00	0.02	a)
XS1492446460	0.6250 % VFC 0 5/8 09/20/23	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1492457665	2.2500 % VTRS 2 1/4 11/22/24	0	700	0	700 EUR	96.41%	674'877.00	0.12	a)
XS1492580516	4.5000 % SLHNVX 4 1/2 PERP EMTN	250	0	0	250 EUR	96.25%	240'625.00	0.04	a)
XS1492685885	0.7500 % ETN 0 3/4 09/20/24	250	0	0	250 EUR	95.21%	238'032.50	0.04	a)
XS1492825051	0.1250 % NOVNVX 0 1/8 09/20/23	550	0	550	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1492825481	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 09/20/28	400	0	0	400 EUR	85.56%	342'224.00	0.06	a)
XS1493320656	0.6250 % CDTFIN 0 5/8 09/22/24 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.80%	237'000.00	0.04	a)
XS1493322355	0.6250 % ENIIM 0 5/8 09/19/24 EMTN	150	150	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1493328477	1.1250 % ENIIM 1 1/8 09/19/28 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1495373505	0.7500 % DSM 0 3/4 09/28/26 EMTN	100	100	0	200 EUR	90.32%	180'644.00	0.03	a)
XS1496758092	0.7500 % ANZ 0 3/4 09/29/26	500	0	0	500 EUR	89.81%	449'025.00	0.08	a)
XS1497312295	0.8750 % CKHH 0 7/8 10/03/24	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1499604905	0.5000 % VOD 0 1/2 01/30/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1501166869	3.3690 % TTEFP 3.369 PERP EMTN	400	0	0	400 EUR	94.38%	377'500.00	0.07	a)
XS1501167164	2.7080 % TTEFP 2.708 PERP EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1501367921	1.0000 % LXSGR 1 10/07/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.63%	183'262.00	0.03	a)
XS1503131713	1.0000 % TRNIM 1 10/11/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	85.97%	214'912.50	0.04	a)
XS1505132602	0.7500 % SWFP 0 3/4 04/14/27	200	0	0	200 EUR	90.64%	181'282.00	0.03	a)
XS1505554771	1.9300 % TELEFO 1.93 10/17/31 EMTN	400	0	0	400 EUR	86.20%	344'796.00	0.06	a)
XS1505568136	1.2500 % TENN 1 1/4 10/24/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	79.20%	158'402.00	0.03	a)
XS1505573482	0.8750 % SRGIM 0 7/8 10/25/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	90.26%	361'056.00	0.06	a)
XS1505884723	1.1250 % EZJLN 1 1/8 10/18/23 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1505890530	1.1250 % CNUNZ 1 1/8 10/18/23 EMTN	0	350	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1505896735	1.3750 % CRHID 1 3/8 10/18/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.64%	175'286.00	0.03	a)
XS1506398244	0.8750 % WSTP 0 7/8 04/17/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.38%	176'760.00	0.03	a)
XS1508450688	2.1250 % UCJIM 2 1/8 10/24/26 EMTN	270	0	0	270 EUR	94.14%	254'178.00	0.04	a)
XS1508586150	1.2500 % SEGPLP 1 1/4 10/25/23	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1508831051	0.7500 % ENGSM 0 3/4 10/27/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.02%	180'048.00	0.03	a)
XS1508912646	1.0000 % ACEIM 1 10/24/26 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1509006380	1.2500 % GS 1 1/4 05/01/25 EMTN	200	150	0	350 EUR	94.63%	331'205.00	0.06	a)
XS1511589605	1.3750 % SEB 1 3/8 10/31/28 GMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1511787589	1.3750 % MS 1 3/8 10/27/26 GMTN	0	500	0	500 EUR	92.07%	460'325.00	0.08	a)
XS1512677003	1.8750 % BFCM 1 7/8 11/04/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	91.43%	365'728.00	0.06	a)
XS1513055555	0.5000 % MRK 0 1/2 11/02/24	0	200	0	200 EUR	94.81%	189'620.00	0.03	a)
XS1513062411	1.3750 % MRK 1 3/8 11/02/36	250	0	0	250 EUR	77.13%	192'822.50	0.03	a)
XS1514149159	1.2500 % WHR 1 1/4 11/02/26	200	0	0	200 EUR	90.85%	181'692.00	0.03	a)
XS1515222385	0.7500 % EQNR 0 3/4 11/09/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	89.99%	179'970.00	0.03	a)
XS1515222468	1.6250 % EQNR 1 5/8 11/09/36 EMTN	0	150	0	150 EUR	76.65%	114'975.00	0.02	a)
XS1517174626	1.0000 % LLOYDS 1 11/09/23 EMTN	450	0	450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1517196272	0.6250 % NAB 0 5/8 11/10/23 GMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1520899532	1.3750 % ABBV 1 3/8 05/17/24	500	0	0	500 EUR	97.04%	485'175.00	0.08	a)
XS1520907814	2.1250 % ABBV 2 1/8 11/17/28	400	0	0	400 EUR	90.97%	363'868.00	0.06	a)
XS1523192588	0.8750 % ULFP 0 7/8 02/21/25 EMTN	150	100	0	250 EUR	94.06%	235'142.50	0.04	a)
XS1527192485	1.3750 % HEIANA 1 3/8 01/29/27 EMTN	100	100	0	200 EUR	91.39%	182'774.00	0.03	a)
XS1527526799	1.0000 % ADENVX 1 12/02/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1527556192	1.6250 % ASML 1 5/8 05/28/27	320	0	0	320 EUR	92.86%	297'164.80	0.05	a)
XS1527758145	1.0000 % IBESM 1 03/07/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.53%	292'587.00	0.05	a)
XS1528093799	1.7500 % ATOSTR 1 3/4 02/01/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	89.39%	178'788.00	0.03	a)
XS1529559525	1.1250 % ECLEAR 1 1/8 12/07/26	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1529684695	1.3750 % BOGAEI 1 3/8 12/05/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.47%	91'468.00	0.02	a)
XS1529859321	1.0000 % ECL 1 01/15/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1531174388	1.8750 % BACR 1 7/8 12/08/23 EMTN	300	100	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1531347661	1.9000 % BDX 1.9 12/15/26	300	0	0	300 EUR	92.99%	278'961.00	0.05	a)
XS1532779748	2.4250 % ZBH 2.425 12/13/26	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1533928971	2.2500 % WPC 2 1/4 07/19/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1538284230	1.8750 % ACAFP 1 7/8 12/20/26 EMTN	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1547407830	1.1250 % BNP 1 1/8 10/10/23 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1548436473	0.7500 % BMW 0 3/4 07/12/24 EMTN	250	0	0	250 EUR	96.28%	240'697.50	0.04	a)
XS1548444816	3.1250 % SANTAN 3 1/8 01/19/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.65%	283'941.00	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1550134602	0.7500 % HND A 0 3/4 01/17/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.50%	194'994.00	0.03	a)
XS1550135831	1.0000 % ACAFP 1 09/16/24 EMTN	700	300	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1550149204	1.0000 % ENELIM 1 09/16/24 EMTN	550	0	0	550 EUR	95.98%	527'890.00	0.09	a)
XS1550951138	2.3180 % TELEFO 2.318 10/17/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.73%	185'460.00	0.03	a)
XS1550951211	1.5280 % TELEFO 1.528 01/17/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	96.20%	480'990.00	0.08	a)
XS1550988643	4.6250 % NNGRNV 4 5/8 01/13/48 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.88%	290'625.00	0.05	a)
XS1551068676	1.5000 % ENIIM 1 1/2 01/17/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1551306951	1.3750 % ISPIIM 1 3/8 01/18/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1551446880	1.3750 % NTGYSM 1 3/8 01/19/27 EMTN	500	0	0	500 EUR	90.95%	454'765.00	0.08	a)
XS1551917591	1.6250 % IGIM 1 5/8 01/19/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	92.39%	230'982.50	0.04	a)
XS1554373248	1.5000 % FREGR 1 1/2 01/30/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1554373677	2.1250 % FREGR 2 1/8 02/01/27	200	0	0	200 EUR	93.21%	186'414.00	0.03	a)
XS1554373834	3.0000 % FREGR 3 01/30/32	250	0	0	250 EUR	86.36%	215'895.00	0.04	a)
XS1554456613	1.2500 % LEGGR 1 1/4 01/23/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1557095616	1.3750 % DT 1 3/8 01/30/27 EMTN	350	0	0	350 EUR	92.58%	324'019.50	0.06	a)
XS1557096267	0.8750 % DT 0 7/8 01/30/24 EMTN	250	150	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1560863802	1.3790 % BAC 1.379 02/07/25 EMTN	200	200	0	400 EUR	97.48%	389'900.00	0.07	a)
XS1562614831	3.5000 % BBVASM 3 1/2 02/10/27 GMTN	300	300	300	300 EUR	96.93%	290'787.00	0.05	a)
XS1564337993	1.8750 % MOLNLY 1 7/8 02/28/25	250	0	0	250 EUR	95.76%	239'407.50	0.04	a)
XS1564394796	2.5000 % INTNED 2 1/2 02/15/29 EMTN	300	0	100	200 EUR	97.25%	194'500.00	0.03	a)
XS1565699763	1.1250 % RYAIID 1 1/8 08/15/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1566101603	1.0000 % UNANA 1 02/14/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	90.49%	361'968.00	0.06	a)
XS1567174286	1.5000 % MCK 1 1/2 11/17/25	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1569845404	1.5000 % ULFP 1 1/2 02/22/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.24%	174'480.00	0.03	a)
XS1570260460	2.0000 % SMINLN 2 02/23/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.79%	185'588.00	0.03	a)
XS1574158082	1.0000 % PFE 0 3/8 03/06/27	250	250	0	500 EUR	91.19%	455'950.00	0.08	a)
XS1574672397	0.5000 % KO 0 1/2 03/08/24	0	200	0	200 EUR	97.02%	194'036.00	0.03	a)
XS1575444622	1.0000 % IBESM 1 03/07/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.97%	284'907.00	0.05	a)
XS1575992596	1.5000 % WKLNA 1 1/2 03/22/27	200	0	0	200 EUR	92.10%	184'202.00	0.03	a)
XS1577586321	1.0000 % SGOF 1 03/17/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.86%	284'592.00	0.05	a)
XS1577950667	1.5000 % BXB AU 1 1/2 10/04/27	150	0	0	150 EUR	89.66%	134'488.50	0.02	a)
XS1577951129	1.3750 % GMGAU 1 3/8 09/27/25 REGS	0	100	0	100 EUR	91.69%	91'694.00	0.02	a)
XS1577951715	1.1510 % ASABRE 1.151 09/19/25	250	0	0	250 EUR	93.36%	233'407.50	0.04	a)
XS1577956789	1.3000 % YANTZE 1.3 06/21/24	0	150	0	150 EUR	96.10%	144'153.00	0.02	a)
XS1577962084	1.3000 % BAX 1.3 05/30/25	250	0	0	250 EUR	94.18%	235'460.00	0.04	a)
XS1578212299	0.8750 % MOTOPG 0 7/8 03/14/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.36%	188'724.00	0.03	a)
XS1580476759	1.0000 % JCI 1 09/15/23	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1582205040	1.1250 % STATK 1 1/8 03/20/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.74%	94'739.00	0.02	a)
XS1584122177	1.1250 % ESSITY 1 1/8 03/27/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.11%	194'218.00	0.03	a)
XS1584122763	1.6250 % ESSITY 1 5/8 03/30/27 EMTN	150	0	0	150 EUR	91.64%	137'452.50	0.02	a)
XS1585010074	1.1250 % NOVNVX 1 1/8 09/30/27	400	0	0	400 EUR	90.18%	360'716.00	0.06	a)
XS1586337872	1.7500 % LIBMUT 1 3/4 03/27/24 REGS	150	0	0	150 EUR	97.38%	146'070.00	0.03	a)
XS1586555861	1.1250 % VW 1 1/8 10/02/23	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1586555945	1.8750 % VW 1 7/8 03/30/27 10Y	600	0	0	600 EUR	91.79%	550'710.00	0.09	a)
XS1587893451	3.3750 % HELNSW 3 3/8 09/29/47	150	0	0	150 EUR	90.88%	136'312.50	0.02	a)
XS1587911451	2.6250 % BFCM 2 5/8 03/31/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.54%	185'082.00	0.03	a)
XS1589806907	1.6250 % HEIGR 1 5/8 04/07/26 EMTN	240	0	0	240 EUR	93.74%	224'971.20	0.04	a)
XS1589881785	0.8750 % BMW 0 7/8 04/03/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.00%	189'990.00	0.03	a)
XS1590568132	1.1250 % NTGYSM 1 1/8 04/11/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.29%	291'861.00	0.05	a)
XS1590787799	3.0000 % TELIAS 3 04/04/2078	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1590823859	3.0000 % INTNED 3 04/11/28 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1591694481	2.9950 % TENN 2.995 PERP	250	0	0	250 EUR	97.88%	244'687.50	0.04	a)
XS1591781452	1.3750 % AMT 1 3/8 04/04/25	0	100	0	100 EUR	94.43%	94'432.00	0.02	a)
XS1595704872	1.0000 % EOANGR 1 04/13/25 DIP	0	250	0	250 EUR	94.60%	236'495.00	0.04	a)
XS1602547264	1.7760 % BAC 1.776 05/04/27 EMTN	500	0	0	500 EUR	92.72%	463'620.00	0.08	a)
XS1603892149	1.8750 % MS 1 7/8 04/27/27 GMTN	0	650	0	650 EUR	91.88%	597'213.50	0.10	a)
XS1605365193	1.3750 % ACAFP 1 3/8 05/03/27 EMTN	1'200	0	1'200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1611855237	2.0200 % HEIANA 2.02 05/12/32 EMTN	0	150	0	150 EUR	86.54%	129'810.00	0.02	a)
XS1612542826	0.8750 % GE 0 7/8 05/17/25	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1612543121	1.5000 % GE 1 1/2 05/17/29	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1613121422	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 05/16/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.52%	193'038.00	0.03	a)
XS1614198262	1.3750 % GS 1 3/8 05/15/24 EMTN	610	0	0	610 EUR	97.44%	594'408.40	0.10	a)
XS1614416193	1.5000 % BNP 1 1/2 11/17/25 EMTN	350	0	0	350 EUR	94.55%	330'932.00	0.06	a)
XS1614722806	1.1250 % CABKSM 1 1/8 05/17/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.72%	290'172.00	0.05	a)
XS1616411119	1.6250 % EOANGR 1 5/8 05/22/29 EMTN	0	350	0	350 EUR	88.07%	308'241.50	0.05	a)
XS1617830721	1.5000 % WFC 1 1/2 05/24/27 EMTN	0	500	0	500 EUR	90.26%	451'285.00	0.08	a)
XS1617831026	1.2500 % BFCM 1 1/4 05/26/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	89.73%	358'924.00	0.06	a)
XS1617845083	0.9500 % IBM 0.95 05/23/25	450	0	0	450 EUR	94.22%	423'967.50	0.07	a)
XS1617845679	1.5000 % IBM 1 1/2 05/23/29	200	100	0	300 EUR	86.82%	260'454.00	0.04	a)
XS1617898363	1.1250 % DT 1 1/8 05/22/26 EMTN	300	200	300	200 EUR	93.02%	186'044.00	0.03	a)
XS1619312173	0.8750 % AAPL 0 7/8 05/24/25	600	700	600	700 EUR	94.46%	661'241.00	0.11	a)
XS1619312686	1.3750 % AAPL 1 3/8 05/24/29	450	450	450	450 EUR	88.21%	396'949.50	0.07	a)
XS1619568303	1.5000 % ULFP 1 1/2 05/29/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	83.70%	167'404.00	0.03	a)
XS1620780202	2.7060 % CLEF 2.706 06/30/50 A8	0	200	0	200 EUR	89.32%	178'644.00	0.03	a)
XS1621351045	1.3750 % EXPNLN 1 3/8 06/25/26 EMTN	0	150	0	150 EUR	92.48%	138'715.50	0.02	a)
XS1622421722	1.7500 % AKFAST 1 3/4 02/07/25 EMTN	200	200	200	200 EUR	93.08%	186'162.00	0.03	a)
XS1623355457	1.6250 % NNGRNV 1 5/8 06/01/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.50%	180'990.00	0.03	a)
XS1623616783	2.2500 % GSWITC 2 1/4 05/31/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.46%	184'920.00	0.03	a)
XS1627193359	1.3750 % SGOFP 1 3/8 06/14/27 EMTN	600	0	0	600 EUR	91.12%	546'702.00	0.09	a)
XS1628004779	1.5000 % VVOYHT 1 1/2 06/19/24	150	0	0	150 EUR	95.25%	142'879.50	0.02	a)
XS1629387462	1.5000 % HEIGR 1 1/2 06/14/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	91.69%	275'070.00	0.05	a)
XS1629774230	3.8750 % VW 3 7/8 PERP	600	0	0	600 EUR	89.13%	534'750.00	0.09	a)
XS1629866432	3.1500 % T 3.15 09/04/36	750	0	0	750 EUR	86.22%	646'657.50	0.11	a)
XS1632897762	0.7500 % TENN 0 3/4 06/26/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.07%	188'148.00	0.03	a)
XS1632897929	1.3750 % TENN 1 3/8 06/26/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.86%	175'726.00	0.03	a)
XS1633784183	3.2500 % XL 3 1/4 06/29/47	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1637093508	0.6250 % CPGLN 0 5/8 07/03/24 EMTN	400	0	0	400 EUR	95.87%	383'468.00	0.07	a)
XS1637162592	1.2000 % DHR 1.2 06/30/27	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1637277572	1.0000 % BNP 1 06/27/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.26%	192'522.00	0.03	a)
XS1637333748	1.5000 % BRITEL 1 1/2 06/23/27 EMTN	500	0	0	500 EUR	90.43%	452'150.00	0.08	a)
XS1637334803	1.0000 % BRITEL 1 06/23/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1637863546	1.6370 % BPLN 1.637 06/26/29 EMTN	150	0	0	150 EUR	87.01%	130'521.00	0.02	a)
XS1641623381	1.8750 % HTHROW 1 7/8 07/12/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	79.65%	238'938.00	0.04	a)
XS1642590480	1.3750 % VW 1 3/8 01/20/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	95.31%	238'275.00	0.04	a)
XS1645494375	1.0000 % NGGLN 1 07/12/24 EMTN	300	100	0	400 EUR	95.81%	383'228.00	0.07	a)
XS1645495349	2.7500 % CABKSM 2 3/4 07/14/28 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1645519031	1.6500 % ANNFND 1.65 07/12/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1648298559	0.8750 % NESNVX 0 7/8 07/18/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.68%	236'687.50	0.04	a)
XS1651453729	2.0000 % NWIDE 2 07/25/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.50%	191'000.00	0.03	a)
XS1652512457	1.3750 % SMDSLN 1 3/8 07/26/24 EMT7	0	200	0	200 EUR	96.12%	192'230.00	0.03	a)
XS1652866002	1.3750 % TRNIM 1 3/8 07/26/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	90.65%	226'620.00	0.04	a)
XS1654192191	0.8750 % UNANA 0 7/8 07/31/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.83%	187'656.00	0.03	a)
XS1654192274	1.3750 % UNANA 1 3/8 07/31/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	87.44%	218'605.00	0.04	a)
XS1672151492	1.7500 % HOLNSW 1 3/4 08/29/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	86.64%	259'905.00	0.04	a)
XS1673102734	1.5000 % ISSDC 1 1/2 08/31/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.39%	176'772.00	0.03	a)
XS1676933853	1.1250 % WSTP 1 1/8 09/05/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.88%	266'649.00	0.05	a)
XS1676933937	0.3750 % WSTP 0 3/8 03/05/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1676952481	0.8750 % SSELN 0 7/8 09/06/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	92.97%	464'870.00	0.08	a)
XS1677902162	0.5000 % CARLB 0 1/2 09/06/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1678966935	1.7500 % CNHI 1 3/4 09/12/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.30%	190'590.00	0.03	a)
XS1679515038	0.6250 % KMB 0 5/8 09/07/24	200	0	0	200 EUR	95.51%	191'028.00	0.03	a)
XS1681050610	1.5000 % LLOYDS 1 1/2 09/12/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	90.33%	361'332.00	0.06	a)
XS1681519184	1.0000 % GSK 1 09/12/26	150	0	0	150 EUR	91.82%	137'722.50	0.02	a)
XS1681520356	1.3750 % GSK 1 3/8 09/12/29	250	0	0	250 EUR	87.26%	218'140.00	0.04	a)
XS1681521081	1.7150 % TELEFO 1.715 01/12/28 EMTN	500	0	0	500 EUR	91.53%	457'635.00	0.08	a)
XS1682538183	1.2500 % IBESM 1 1/4 09/13/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.48%	182'956.00	0.03	a)
XS1685481332	0.6250 % NAB 0 5/8 09/18/24 GMTN	200	0	0	200 EUR	95.38%	190'760.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1685542497	1.6250 % IGIM 1 5/8 01/18/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	87.36%	262'089.00	0.05	a)
XS1685653211	1.7500 % LSELN 1 3/4 09/19/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.46%	176'912.00	0.03	a)
XS1685653302	0.8750 % LSELN 0 7/8 09/19/24 EMTN	150	0	0	150 EUR	95.70%	143'548.50	0.02	a)
XS1685798370	0.8750 % ADNA 0 7/8 09/19/24	200	0	0	200 EUR	95.65%	191'306.00	0.03	a)
XS1686846061	1.6250 % AALLN 1 5/8 09/18/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.85%	189'704.00	0.03	a)
XS1688199949	1.8750 % ATOSTR 1 7/8 09/26/29 EMTN	0	180	0	180 EUR	81.90%	147'411.00	0.03	a)
XS1689185426	1.5000 % MGCN 1 1/2 09/25/27	250	0	0	250 EUR	90.33%	225'815.00	0.04	a)
XS1689523840	1.1250 % BNRGR 1 1/8 09/27/25	200	0	0	200 EUR	93.59%	187'180.00	0.03	a)
XS1689535000	1.1250 % NDASS 1 1/8 09/27/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	90.13%	225'320.00	0.04	a)
XS1689540935	1.6250 % INTNED 1 5/8 09/26/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.88%	281'625.00	0.05	a)
XS1691349952	2.0650 % NATUEN 2.065 09/28/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.88%	183'758.00	0.03	a)
XS1691781865	1.5000 % HEIANA 1 1/2 10/03/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.95%	173'908.00	0.03	a)
XS1692332684	1.9360 % CBAAU 1.936 10/03/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.88%	284'625.00	0.05	a)
XS1692347526	1.1250 % VWV 1 1/8 04/04/24 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.09%	242'720.00	0.04	a)
XS1693281617	1.6250 % STANLN 1 5/8 10/03/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.99%	181'972.00	0.03	a)
XS1693818525	1.3750 % TTEFP 1 3/8 10/04/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	86.08%	258'225.00	0.04	a)
XS1700721464	1.3750 % SRGIM 1 3/8 10/25/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.08%	90'080.00	0.02	a)
XS1704789590	1.5000 % IREIM 1 1/2 10/24/27 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1705553250	0.8750 % STEDIN 0 7/8 10/24/25 EMTN	150	0	0	150 EUR	92.86%	139'288.50	0.02	a)
XS1706111793	1.3420 % MS 1.342 10/23/26 EMTN	0	350	0	350 EUR	93.09%	325'797.50	0.06	a)
XS1707074941	0.3750 % NESNVX 0 3/8 01/18/24 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.80%	244'490.00	0.04	a)
XS1707075245	1.7500 % NESNVX 1 3/4 11/02/37 EMTN	250	0	0	250 EUR	79.58%	198'955.00	0.03	a)
XS1707075328	1.2500 % NESNVX 1 1/4 11/02/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	87.17%	217'912.50	0.04	a)
XS1708192684	0.5000 % PG 0 1/2 10/25/24	200	0	0	200 EUR	94.94%	189'888.00	0.03	a)
XS1708193815	1.2500 % PG 1 1/4 10/25/29	200	0	0	200 EUR	86.75%	173'502.00	0.03	a)
XS1709374497	1.6080 % FIREIT 1.608 10/31/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	89.44%	223'600.00	0.04	a)
XS1713463559	3.3750 % ENELIM 3 3/8 PERP 635	200	0	0	200 EUR	91.00%	182'000.00	0.03	a)
XS1713463716	2.5000 % ENELIM 2 1/2 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1716616179	1.1000 % WHR 1.1 11/09/27	0	100	0	100 EUR	87.53%	87'528.00	0.02	a)
XS1717012014	0.5000 % BZLNZ 0 1/2 05/13/23 GMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1717355561	1.6250 % BFCM 1 5/8 11/15/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.85%	173'696.00	0.03	a)
XS1717433541	1.1250 % AKFAST 1 1/8 03/14/24 EMTN	200	0	100	100 EUR	96.14%	96'135.00	0.02	a)
XS1717441726	1.5000 % UPS 1 1/2 11/15/32	200	0	0	200 EUR	81.26%	162'518.00	0.03	a)
XS1718316281	1.3750 % SOCGEN 1 3/8 01/13/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.91%	173'820.00	0.03	a)
XS1718393439	0.8750 % NTGYSM 0 7/8 05/15/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.67%	187'332.00	0.03	a)
XS1718417717	1.6250 % BASGR 1 5/8 11/15/37 DIP	300	0	0	300 EUR	72.86%	218'574.00	0.04	a)
XS1718418103	0.8750 % BASGR 0 7/8 11/15/27 DIP	300	0	0	300 EUR	90.37%	271'104.00	0.05	a)
XS1718480327	0.3750 % UPS 0 3/8 11/15/23	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1720192696	2.2500 % ORSTED 2 1/4 11/24/3017	300	0	0	300 EUR	94.63%	283'875.00	0.05	a)
XS1720922175	1.0000 % BRITEL 1 11/21/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.16%	190'322.00	0.03	a)
XS1721051495	1.5000 % EDPLP 1 1/2 11/22/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.20%	180'406.00	0.03	a)
XS1721244371	1.8750 % IBESM 1 7/8 PERP	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1721422068	1.8750 % VOD 1 7/8 11/20/29 EMTN	500	0	0	500 EUR	87.67%	438'370.00	0.08	a)
XS1721422902	2.8750 % VOD 2 7/8 11/20/37 EMTN	250	0	0	250 EUR	84.03%	210'077.50	0.04	a)
XS1721423462	1.1250 % VOD 1 1/8 11/20/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	93.42%	233'540.00	0.04	a)
XS1721760541	1.5000 % ORSTED 1 1/2 11/26/29	300	0	0	300 EUR	86.24%	258'723.00	0.04	a)
XS1722801708	1.5000 % BNP 1 1/2 05/23/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	86.54%	216'357.50	0.04	a)
XS1722898431	1.7500 % NEPSJ 1 3/4 11/23/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.77%	189'536.00	0.03	a)
XS1724873275	1.0000 % SZUGR 1 11/28/25	0	200	0	200 EUR	93.33%	186'664.00	0.03	a)
XS1725630740	0.6250 % MCD 0 5/8 01/29/24 GMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1725677543	1.6250 % COLSM 1 5/8 11/28/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.27%	186'530.00	0.03	a)
XS1726152108	1.6210 % IBESM 1.621 11/29/29	200	0	0	200 EUR	89.60%	179'200.00	0.03	a)
XS1729879822	1.3750 % CASHSM 1 3/8 02/04/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.21%	186'426.00	0.03	a)
XS1729882024	2.2500 % TALANX 2 1/4 12/05/47 GDIP	0	400	200	200 EUR	86.75%	173'500.00	0.03	a)
XS1730885073	1.3750 % INTNED 1 3/8 01/11/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.19%	264'555.00	0.05	a)
XS1731105612	0.8750 % SABSM 0 7/8 03/05/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1732232340	0.6250 % DT 0 5/8 12/13/24 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1733289406	4.2500 % CASSIM 4 1/4 12/14/47	0	200	100	100 EUR	96.00%	96'000.00	0.02	a)
XS1734066811	3.1250 % PVH 3 1/8 12/15/27 REGS	200	200	200	200 EUR	93.23%	186'468.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1734533372	1.0000 % DPWGR 1 12/13/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.51%	181'014.00	0.03	a)
XS1734548487	0.7500 % VW 0 3/4 06/15/23 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1734548644	1.2500 % VW 1 1/4 12/15/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.15%	186'298.00	0.03	a)
XS1734689620	1.0000 % OMVAV 1 12/14/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	91.12%	227'797.50	0.04	a)
XS1747444245	0.3750 % BMW 0 3/8 07/10/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1747444831	1.1250 % BMW 1 1/8 01/10/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.83%	179'656.00	0.03	a)
XS1748456974	1.1250 % BNP 1 1/8 06/11/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	91.54%	228'852.50	0.04	a)
XS1750122225	0.7500 % BFCM 0 3/4 07/17/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	92.79%	371'164.00	0.06	a)
XS1750349190	1.1250 % CBAAU 1 1/8 01/18/28	200	0	0	200 EUR	88.11%	176'214.00	0.03	a)
XS1750986744	1.1250 % ENELIM 1 1/8 09/16/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	91.71%	229'280.00	0.04	a)
XS1751004232	1.1250 % SANTAN 1 1/8 01/17/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	94.84%	474'220.00	0.08	a)
XS1752476538	0.7500 % CABKSM 0 3/4 04/18/23 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1755428502	1.5000 % NTGYSM 1 1/2 01/29/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.66%	268'971.00	0.05	a)
XS1756296965	1.4470 % TELEFO 1.447 01/22/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.07%	276'207.00	0.05	a)
XS1757377400	1.6250 % ALLRNV 1 5/8 PERP	200	0	0	200 EUR	92.25%	184'500.00	0.03	a)
XS1757394322	1.3750 % BACR 1 3/8 01/24/26 EMTN	500	0	0	500 EUR	94.38%	471'875.00	0.08	a)
XS1759603761	1.0000 % PSGSM 1 02/08/23	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1767087866	1.5000 % ACEIM 1 1/2 06/08/27 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1767931121	2.1250 % SANTAN 2 1/8 02/08/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	88.88%	355'532.00	0.06	a)
XS1769041192	1.3750 % NOVNVX 1 3/8 08/14/30	200	0	0	200 EUR	86.78%	173'564.00	0.03	a)
XS1769041606	1.7000 % NOVNVX 1.7 08/14/38	250	0	0	250 EUR	78.97%	197'432.50	0.03	a)
XS1769091296	1.6250 % UNANA 1 5/8 02/12/33 EMTN	350	0	0	350 EUR	83.80%	293'300.00	0.05	a)
XS1771723167	1.6250 % MCK 1 5/8 10/30/26	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1771838494	1.1250 % INTNED 1 1/8 02/14/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.11%	285'333.00	0.05	a)
XS1775786574	1.6250 % SAMPFH 1 5/8 02/21/28 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1781346801	0.7500 % SCBNOR 0 3/4 03/01/23 EMTN	200	100	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1785340172	1.7500 % ISPIM 1 3/4 03/20/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	87.85%	351'388.00	0.06	a)
XS1785458172	2.1250 % WPC 2 1/8 04/15/27	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1787477543	1.1250 % ADNA 1 1/8 03/19/26	200	0	0	200 EUR	92.46%	184'928.00	0.03	a)
XS1788515606	1.7500 % NWG 1 3/4 03/02/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	94.59%	378'340.00	0.07	a)
XS1788834700	1.5000 % NWIDE 1 1/2 03/08/26	300	0	0	300 EUR	94.19%	282'564.00	0.05	a)
XS1788951090	0.5000 % SEB 0 1/2 03/13/23 GMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1788982996	1.7500 % LLOYDS 1 3/4 09/07/28 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1789699607	1.7500 % MAERSK 1 3/4 03/16/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	93.91%	234'765.00	0.04	a)
XS1789751531	1.0000 % CFRVX 1 03/26/26	0	450	0	450 EUR	93.04%	418'671.00	0.07	a)
XS1789752182	1.5000 % CFRVX 1 1/2 03/26/30	0	300	0	300 EUR	87.85%	263'547.00	0.05	a)
XS1789759195	2.0000 % CFRVX 2 03/26/38	0	300	0	300 EUR	79.03%	237'087.00	0.04	a)
XS1790990474	1.3750 % ACAFP 1 3/8 03/13/25 EMTN	200	200	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1792505866	1.6940 % GM 1.694 03/26/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.35%	286'050.00	0.05	a)
XS1793252419	1.2500 % BNP 1 1/4 03/19/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.95%	237'372.50	0.04	a)
XS1793316834	0.5500 % HNDA 0.55 03/17/23	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1793349926	1.1250 % SGOPF 1 1/8 03/23/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.74%	278'232.00	0.05	a)
XS1795252672	1.6250 % C 1 5/8 03/21/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.94%	266'823.00	0.05	a)
XS1796079488	2.0000 % INTNED 2 03/22/30	300	0	0	300 EUR	93.13%	279'375.00	0.05	a)
XS1796209010	2.0000 % GS 2 03/22/28 EMTN	263	0	0	263 EUR	90.52%	238'072.86	0.04	a)
XS1796257092	0.7500 % CM 0 3/4 03/22/23 DPNT	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1799061558	0.8750 % DANBNK 0 7/8 05/22/23 EMTN	450	0	450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1799545329	1.8750 % ACSSCE 1 7/8 04/20/26	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1799611642	3.2500 % AXASA 3 1/4 05/28/49 EMTN	600	0	0	600 EUR	90.00%	540'000.00	0.09	a)
XS1799938995	3.3750 % VW 3 3/8 PERP NC6	400	0	0	400 EUR	95.88%	383'500.00	0.07	a)
XS1799939027	4.6250 % VW 4 5/8 PERP	400	0	0	400 EUR	91.00%	364'000.00	0.06	a)
XS1799975922	3.0000 % GWILN 3 03/29/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	88.93%	222'312.50	0.04	a)
XS1801129286	2.1250 % VTRS 2 1/8 05/23/25	0	100	0	100 EUR	95.38%	95'376.00	0.02	a)
XS1803247557	1.1250 % SCMNVD 1 1/8 10/12/26	200	0	0	200 EUR	91.08%	182'152.00	0.03	a)
XS1806124753	1.2500 % CKHH 1 1/4 04/13/25	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1806368897	1.7500 % SCGAU 1 3/4 04/11/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.32%	172'640.00	0.03	a)
XS1806457211	0.8750 % VW 0 7/8 04/12/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1808338542	1.0000 % BNP 1 04/17/24 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.03%	242'570.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
X51808351214	2.2500 % CABKSM 2 1/4 04/17/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.75%	278'250.00	0.05	a)
X51808395930	2.0000 % COLSM 2 04/17/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.53%	187'050.00	0.03	a)
X51808482746	1.1250 % HANRUE 1 1/8 04/18/28	0	300	0	300 EUR	87.51%	262'524.00	0.05	a)
X51808739459	0.8750 % ABNAV 0 7/8 04/22/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.44%	283'305.00	0.05	a)
X51810653540	1.7500 % HEIGR 1 3/4 04/24/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.31%	178'624.00	0.03	a)
X51811024543	1.6590 % ENAPHO 1.659 04/26/24	300	0	0	300 EUR	92.25%	276'762.00	0.05	a)
X51811435251	1.6620 % BAC 1.662 04/25/28 EMTN	350	0	0	350 EUR	90.20%	315'686.00	0.05	a)
X51812905526	1.2500 % AUSGF 1 1/4 07/30/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.55%	187'100.00	0.03	a)
X51813593313	1.6250 % MNDILN 1 5/8 04/27/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.63%	185'254.00	0.03	a)
X51814402878	1.0000 % LPTY 1 05/02/23 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51815116568	0.7500 % PHIANA 0 3/4 05/02/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51815116998	1.3750 % PHIANA 1 3/8 05/02/28	150	0	0	150 EUR	88.03%	132'040.50	0.02	a)
X51820037270	1.3750 % BBVASM 1 3/8 05/14/25 GMTN	300	200	300	200 EUR	94.66%	189'318.00	0.03	a)
X51822828122	1.2500 % GSK 1 1/4 05/21/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.76%	185'512.00	0.03	a)
X51822829799	1.7500 % GSK 1 3/4 05/21/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	88.10%	220'247.50	0.04	a)
X51823246803	1.1250 % BMW 1 1/8 05/22/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.20%	279'600.00	0.05	a)
X51823300949	1.9500 % AMT 1.95 05/22/26	200	0	0	200 EUR	92.78%	185'552.00	0.03	a)
X51823485039	1.0000 % OPBANK 1 05/22/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.07%	188'142.00	0.03	a)
X51823502577	1.5000 % BASGR 1 1/2 05/22/30 12Y	150	0	0	150 EUR	86.41%	129'610.50	0.02	a)
X51823502650	0.8750 % BASGR 0 7/8 05/22/25 7Y	150	0	0	150 EUR	95.58%	143'365.50	0.02	a)
X51823518730	1.0000 % WURTH 1 05/26/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.33%	190'658.00	0.03	a)
X51823532640	1.1250 % BNP 1 1/8 11/22/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51823623878	1.8750 % CNHI 1 7/8 01/19/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	94.60%	141'904.50	0.02	a)
X51824235219	0.8750 % SANSFC 0 7/8 05/30/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51824240136	2.5000 % BFCM 2 1/2 05/25/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	89.09%	178'188.00	0.03	a)
X51828032786	1.3750 % DT 1 3/8 12/01/25 EMTN	300	300	0	600 EUR	95.01%	570'078.00	0.10	a)
X51828033834	2.0000 % DT 2 12/01/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	90.93%	272'799.00	0.05	a)
X51828037827	2.0000 % TENN 2 06/05/34 EMTN	0	150	0	150 EUR	84.35%	126'526.50	0.02	a)
X51830986326	1.2500 % VW 1 1/4 06/10/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.42%	289'251.00	0.05	a)
X51837288494	1.1250 % KNOGR 1 1/8 06/13/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.89%	237'212.50	0.04	a)
X51839680680	1.7500 % MAN 1 3/4 06/22/26	200	0	0	200 EUR	93.00%	186'008.00	0.03	a)
X51840618059	1.5000 % BAYNGR 1 1/2 06/26/26	600	0	0	600 EUR	92.37%	554'214.00	0.10	a)
X51840618216	2.1250 % BAYNGR 2 1/8 12/15/29	500	0	0	500 EUR	88.40%	442'010.00	0.08	a)
X51842961440	0.8750 % NDASS 0 7/8 06/26/23 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51843434793	1.0000 % ITW 1 06/05/31	200	0	0	200 EUR	81.66%	163'326.00	0.03	a)
X51843435170	0.6250 % ITW 0 5/8 12/05/27	200	0	0	200 EUR	87.04%	174'080.00	0.03	a)
X51843435253	0.2500 % ITW 0 1/4 12/05/24	250	0	0	250 EUR	94.11%	235'272.50	0.04	a)
X51843437036	2.2000 % RURAIL 2.2 05/23/27	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51843442622	1.7500 % NDAQ 1 3/4 03/28/29	0	250	0	250 EUR	87.17%	217'915.00	0.04	a)
X51843443190	2.2000 % MO 2.2 06/15/27	400	0	0	400 EUR	90.84%	363'352.00	0.06	a)
X51843443513	1.7000 % MO 1.7 06/15/25	300	0	0	300 EUR	94.99%	284'973.00	0.05	a)
X51843443786	3.1250 % MO 3 1/8 06/15/31	470	0	0	470 EUR	83.89%	394'278.30	0.07	a)
X51843448314	3.2500 % MUNRE 3 1/4 05/26/49	400	0	0	400 EUR	90.50%	362'000.00	0.06	a)
X51843449122	2.2500 % TACHEM 2 1/4 11/21/26 REGS	411	411	411	411 EUR	94.62%	388'896.42	0.07	a)
X51843449395	3.0000 % TACHEM 3 11/21/30 REGS	411	411	411	411 EUR	92.71%	381'021.66	0.07	a)
X51843459436	2.0000 % APH 2 10/08/28	200	0	0	200 EUR	92.49%	184'982.00	0.03	a)
X51843459600	2.2500 % WPC 2 1/4 04/09/26	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51843459782	1.8000 % IFF 1.8 09/25/26	0	250	0	250 EUR	91.21%	228'015.00	0.04	a)
X51844079738	0.7500 % DEVOBA 0 3/4 06/25/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51846632104	1.6250 % EDPL 1 5/8 01/26/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	94.37%	141'561.00	0.02	a)
X51847692636	1.2500 % IBESM 1 1/4 10/28/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.65%	185'298.00	0.03	a)
X51849518276	2.8750 % SKGID 2 7/8 01/15/26	250	0	0	250 EUR	96.85%	242'127.50	0.04	a)
X51849550592	2.2500 % AIB 2 1/4 07/03/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.71%	191'422.00	0.03	a)
X51851278777	1.5940 % BPLN 1.594 07/03/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.46%	176'916.00	0.03	a)
X51853426549	1.5000 % INFLN 1 1/2 07/05/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51854166078	2.0000 % VESTNL 2 07/10/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	93.32%	139'974.00	0.02	a)
X51856791873	0.5000 % ABNAV 0 1/2 07/17/23 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51856797219	1.4500 % WSTP 1.45 07/17/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	88.59%	221'472.50	0.04	a)
X51856797300	0.7500 % WSTP 0 3/4 10/17/23 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1856834608	1.3750 % BFCM 1 3/8 07/16/28 EMTN	500	0	0	500 EUR	87.69%	438'445.00	0.08	a)
XS1857683335	0.6250 % TD 0 5/8 07/20/23 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1859010685	1.5000 % C 1 1/2 07/24/26 EMTN	450	100	0	550 EUR	93.84%	516'131.00	0.09	a)
XS1861206636	2.0000 % GS 2 11/01/28 EMTN	411	0	0	411 EUR	89.56%	368'108.04	0.06	a)
XS1861322383	1.8750 % PLD 1 7/8 01/05/29	450	0	0	450 EUR	87.91%	395'604.00	0.07	a)
XS1864037541	0.7500 % NGGLN 0 3/4 08/08/23 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1865186321	1.0000 % VW 1 02/16/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1865186677	1.6250 % VW 1 5/8 08/15/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.02%	285'066.00	0.05	a)
XS1867412006	2.0000 % CHGDN 2 09/11/25	200	0	0	200 EUR	93.69%	187'380.00	0.03	a)
XS1870225338	0.4000 % SWEDA 0.4 08/29/23 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1871094931	0.3750 % OPBANK 0 3/8 08/29/23 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1871439342	0.7500 % RABOBK 0 3/4 08/29/23 GMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1872032799	1.3750 % NAB 1 3/8 08/30/28 GMTN	400	0	0	400 EUR	88.32%	353'264.00	0.06	a)
XS1872038218	1.3750 % BKIR 1 3/8 08/29/23 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1873143645	1.0000 % BMW 1 08/29/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.51%	283'536.00	0.05	a)
XS1873208950	0.5000 % UNANA 0 1/2 01/06/25 6Y	250	0	0	250 EUR	94.57%	236'432.50	0.04	a)
XS1873209172	1.3750 % UNANA 1 3/8 09/04/30	150	0	0	150 EUR	85.76%	128'646.00	0.02	a)
XS1874122267	1.4910 % TTEFP 1.491 09/04/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	85.26%	170'516.00	0.03	a)
XS1874122770	1.0230 % TTEFP 1.023 03/04/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.39%	180'784.00	0.03	a)
XS1874127811	0.3750 % SIEGR 0 3/8 09/06/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1874127902	1.3750 % SIEGR 1 3/8 09/06/30 EMTN	150	180	0	330 EUR	85.99%	283'776.90	0.05	a)
XS1874128033	1.0000 % SIEGR 1 09/06/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	90.89%	272'664.00	0.05	a)
XS1875275205	2.0000 % NWG 2 03/04/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.68%	293'052.00	0.05	a)
XS1875284702	1.3750 % SSELN 1 3/8 09/04/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	90.50%	271'485.00	0.05	a)
XS1875331636	1.1250 % GIVNVX 1 1/8 09/17/25 EUR	300	0	0	300 EUR	93.51%	280'515.00	0.05	a)
XS1876076040	1.6250 % SABSM 1 5/8 03/07/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.76%	195'512.00	0.03	a)
XS1877595014	1.7500 % HEIANA 1 3/4 03/17/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	85.87%	257'622.00	0.04	a)
XS1877595444	1.2500 % HEIANA 1 1/4 03/17/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	90.87%	181'738.00	0.03	a)
XS1877836079	1.0000 % ADM 1 09/12/25	250	0	0	250 EUR	93.68%	234'195.00	0.04	a)
XS1877846110	1.4950 % TELEFO 1.495 09/11/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.91%	189'828.00	0.03	a)
XS1877937851	2.1950 % FIREIT 2.195 09/11/25 EMTN	150	0	0	150 EUR	95.48%	143'218.50	0.02	a)
XS1878191052	0.8750 % AMSSM 0 7/8 09/18/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1878191219	1.5000 % AMSSM 1 1/2 09/18/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.65%	185'296.00	0.03	a)
XS1878266326	1.3750 % STEDIN 1 3/8 09/19/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.64%	177'270.00	0.03	a)
XS1879112495	2.0000 % GIVNVX 2 09/17/30 EUR	300	0	0	300 EUR	87.55%	262'656.00	0.05	a)
XS1880919383	1.3750 % SYDBDC 1 3/8 09/18/23 GMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1880928459	1.5000 % SWEDA 1 1/2 09/18/28 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1882544973	2.0000 % INTNED 2 09/20/28 EMTN	500	0	0	500 EUR	89.74%	448'685.00	0.08	a)
XS1883245331	1.7500 % DXC 1 3/4 01/15/26	250	0	0	250 EUR	92.64%	231'587.50	0.04	a)
XS1883352095	1.1250 % JAPTOB 1 1/8 09/28/25 EMTN	200	100	200	100 EUR	92.35%	92'354.00	0.02	a)
XS1883354620	0.8750 % ABT 0 7/8 09/27/23	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1883355197	1.5000 % ABT 1 1/2 09/27/26 EUR	400	0	0	400 EUR	93.12%	372'492.00	0.06	a)
XS1883878966	2.3750 % DPWDU 2 3/8 09/25/26 REGS	250	0	0	250 EUR	94.28%	235'700.00	0.04	a)
XS1886543476	3.0000 % CRTING 3 03/15/24 REGS	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1888184121	2.2500 % SAMPFH 2 1/4 09/27/30 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1888206627	1.1250 % SANSFC 1 1/8 10/09/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1890836296	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 12/15/28	0	150	0	150 EUR	88.18%	132'268.50	0.02	a)
XS1890845875	3.2500 % IBESM 3 1/4 PERP	400	0	0	400 EUR	96.50%	386'000.00	0.07	a)
XS1891174341	2.5000 % DLR 2 1/2 01/16/26	300	0	0	300 EUR	93.79%	281'379.00	0.05	a)
XS1891336932	2.8750 % PLNIJ 2 7/8 10/25/25 REGS	0	150	0	150 EUR	96.08%	144'126.00	0.02	a)
XS1893621026	1.8750 % EDPL 1 7/8 10/13/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	95.73%	239'332.50	0.04	a)
XS1893631330	1.3750 % VW 1 3/8 10/16/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1893631769	2.2500 % VW 2 1/4 10/16/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.62%	286'854.00	0.05	a)
XS1896660989	1.0000 % DGELN 1 04/22/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.61%	94'607.00	0.02	a)
XS1896662175	1.5000 % DGELN 1 1/2 10/22/27 EMTN	150	0	0	150 EUR	91.20%	136'794.00	0.02	a)
XS1896851224	1.3750 % TSCOLN 1 3/8 10/24/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1897489578	1.7500 % CABKSM 1 3/4 10/24/23 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1898256257	1.0000 % SLB 1 02/18/26	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1900750107	0.6250 % PG 0 5/8 10/30/24	300	0	0	300 EUR	95.30%	285'894.00	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1900752814	1.2000 % PG 1.2 10/30/28	200	0	0	200 EUR	88.41%	176'818.00	0.03	a)
XS1900752905	1.8750 % PG 1 7/8 10/30/38	250	0	0	250 EUR	80.37%	200'927.50	0.03	a)
XS1901055472	1.8750 % ENBW 1 7/8 10/31/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.99%	161'982.00	0.03	a)
XS1907120528	1.8000 % T 1.8 09/05/26	500	0	0	500 EUR	93.17%	465'845.00	0.08	a)
XS1907120791	2.3500 % T 2.35 09/05/29	450	0	0	450 EUR	89.91%	404'614.80	0.07	a)
XS1907122656	1.5000 % CCEP 1 1/2 11/08/27	300	0	0	300 EUR	89.86%	269'580.00	0.05	a)
XS1907150350	1.1250 % TELBSS 1 1/8 05/15/24 EMTN	150	0	0	150 EUR	96.31%	144'457.50	0.02	a)
XS1907150780	2.1250 % TELBSS 2 1/8 05/15/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.51%	181'022.00	0.03	a)
XS1909057306	2.2500 % LOGICR 2 1/4 05/13/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.61%	185'228.00	0.03	a)
XS1909057645	3.2500 % LOGICR 3 1/4 11/13/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.67%	173'342.00	0.03	a)
XS1909186451	2.5000 % INTNED 2 1/2 11/15/30 EMTN	500	0	100	400 EUR	89.99%	359'960.00	0.06	a)
XS1910245676	1.0000 % BMW 1 11/14/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.95%	287'856.00	0.05	a)
XS1910948162	2.6250 % VW 2 5/8 11/16/27	200	0	0	200 EUR	93.65%	187'308.00	0.03	a)
XS1910948329	3.2500 % VW 3 1/4 11/18/30	400	0	0	400 EUR	92.44%	369'748.00	0.06	a)
XS1910948675	4.1250 % VW 4 1/8 11/16/38	400	0	0	400 EUR	92.80%	371'212.00	0.06	a)
XS1914502304	2.1250 % SYK 2 1/8 11/30/27	0	150	0	150 EUR	92.78%	139'173.00	0.02	a)
XS1914502643	2.6250 % SYK 2 5/8 11/30/30	0	150	0	150 EUR	91.04%	136'554.00	0.02	a)
XS1917358621	1.6250 % DPWGR 1 5/8 12/05/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	91.59%	228'980.00	0.04	a)
XS1917590876	0.7500 % OMVAV 0 3/4 12/04/23 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1917590959	1.8750 % OMVAV 1 7/8 12/04/28 EMTN	150	0	0	150 EUR	91.29%	136'929.00	0.02	a)
XS1917601582	1.5000 % HSBC 1 1/2 12/04/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1918000107	1.7500 % LSELN 1 3/4 12/06/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.08%	276'234.00	0.05	a)
XS1928480166	2.2500 % BACRED 2.05 01/25/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1933820372	2.1250 % INTNED 2 1/8 01/10/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.45%	286'347.00	0.05	a)
XS1935139995	0.8750 % ABNAV 0 7/8 01/15/24 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1936208252	1.8750 % FREGR 1 7/8 02/15/25 6Y	200	0	0	200 EUR	96.44%	192'874.00	0.03	a)
XS1936208419	2.8750 % FREGR 2 7/8 02/15/29 10Y	100	0	0	100 EUR	91.55%	91'554.00	0.02	a)
XS1936805776	2.3750 % CABKSM 2 3/8 02/01/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.73%	296'193.00	0.05	a)
XS1937665955	1.5000 % ENELIM 1 1/2 07/21/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	94.94%	379'764.00	0.07	a)
XS1939356645	2.2000 % GM 2.2 04/01/24 EMTN	0	100	0	100 EUR	98.27%	98'270.00	0.02	a)
XS1941841311	3.8750 % ASSGEN 3 7/8 01/29/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.60%	191'206.00	0.03	a)
XS1942708527	2.7500 % ZURNVX 2 3/4 02/19/49	120	0	0	120 EUR	88.00%	105'600.00	0.02	a)
XS1944390241	1.8750 % VW 1 7/8 01/31/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.07%	196'144.00	0.03	a)
XS1944390597	2.5000 % VW 2 1/2 07/31/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.47%	188'936.00	0.03	a)
XS1944456109	0.8750 % IBM 0 7/8 01/31/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.67%	284'019.00	0.05	a)
XS1945110606	1.2500 % IBM 1 1/4 01/29/27	300	0	0	300 EUR	91.21%	273'630.00	0.05	a)
XS1945110861	1.7500 % IBM 1 3/4 01/31/31	500	0	0	500 EUR	85.01%	425'035.00	0.07	a)
XS1946004451	1.0690 % TELEFO 1.069 02/05/24 EMTN	100	100	0	200 EUR	97.63%	195'250.00	0.03	a)
XS1948611840	1.5000 % BMW 1 1/2 02/06/29 EMTN	500	0	0	500 EUR	89.32%	446'595.00	0.08	a)
XS1948612905	0.6250 % BMW 0 5/8 10/06/23 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1951220596	3.7500 % CABKSM 3 3/4 02/15/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.63%	197'250.00	0.03	a)
XS1953240261	2.1250 % TELIAS 2 1/8 02/20/34 EMTN	0	150	0	150 EUR	83.13%	124'692.00	0.02	a)
XS1953271225	4.8750 % UC GIM 4 7/8 02/20/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	99.13%	247'812.50	0.04	a)
XS1953929608	2.8000 % ACQUIU 2.8 02/20/26	200	0	0	200 EUR	95.36%	190'714.00	0.03	a)
XS1954087695	2.5750 % BBVASM 2.575 02/22/29 GMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1955024986	1.2500 % KO 1 1/4 03/08/31	200	0	0	200 EUR	82.97%	165'940.00	0.03	a)
XS1955187692	0.3000 % SIEGR 0.3 02/28/24	300	0	0	300 EUR	96.83%	290'487.00	0.05	a)
XS1955187775	0.9000 % SIEGR 0.9 02/28/28	0	200	0	200 EUR	88.61%	177'218.00	0.03	a)
XS1955187858	1.2500 % SIEGR 1 1/4 02/28/31	250	0	0	250 EUR	83.91%	209'762.50	0.04	a)
XS1955187932	1.7500 % SIEGR 1 3/4 02/28/39 EMTN	230	0	0	230 EUR	76.41%	175'740.70	0.03	a)
XS1956022716	0.3750 % OPBANK 0 3/8 02/26/24 EMTN	0	150	0	150 EUR	96.73%	145'096.50	0.02	a)
XS1956025651	1.0000 % SANSCF 1 02/27/24 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.27%	194'530.00	0.03	a)
XS1956027947	2.1250 % FUMVFH 2 1/8 02/27/29 EMTN	150	0	0	150 EUR	89.24%	133'857.00	0.02	a)
XS1956028168	0.8750 % FUMVFH 0 7/8 02/27/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1956037664	1.6250 % FUMVFH 1 5/8 02/27/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	92.75%	231'875.00	0.04	a)
XS1956955980	0.6250 % RABOBK 0 5/8 02/27/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.97%	290'907.00	0.05	a)
XS1956973967	1.1250 % BBVASM 1 1/8 02/28/24 GMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1957442541	1.2500 % SRGIM 1 1/4 08/28/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.83%	93'828.00	0.02	a)
XS1958307461	1.7500 % ACAFP 1 3/4 03/05/29 EMTN	300	200	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1958646082	0.5000 % CL 0 1/2 03/06/26	150	0	0	150 EUR	91.67%	137'506.50	0.02	a)
XS1958648294	1.3750 % CL 1 3/8 03/06/34 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.75%	161'506.00	0.03	a)
XS1960260021	1.3750 % LPTY 1 3/8 03/07/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.39%	194'770.00	0.03	a)
XS1960678099	0.3750 % MDT 0 3/8 03/07/23 0000	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1960678255	1.1250 % MDT 1 1/8 03/07/27	500	0	0	500 EUR	90.29%	451'425.00	0.08	a)
XS1960678412	1.6250 % MDT 1 5/8 03/07/31	320	0	0	320 EUR	85.02%	272'073.60	0.05	a)
XS1960678685	2.2500 % MDT 2 1/4 03/07/39	300	0	0	300 EUR	77.36%	232'092.00	0.04	a)
XS1961772560	1.7880 % TELEFO 1.788 03/12/29 EMTN	400	0	0	400 EUR	89.83%	359'328.00	0.06	a)
XS1962513674	1.6250 % AALLN 1 5/8 03/11/26 EMTN	100	400	0	500 EUR	93.25%	466'240.00	0.08	a)
XS1962554785	0.6250 % SGOPF 0 5/8 03/15/24	300	0	0	300 EUR	96.80%	290'397.00	0.05	a)
XS1962571011	1.8750 % SGOPF 1 7/8 03/15/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	86.31%	258'927.00	0.04	a)
XS1963116964	2.5340 % SRENVX 2.534 04/30/50	200	0	0	200 EUR	83.57%	167'134.00	0.03	a)
XS1963553919	0.7500 % PEP 0 3/4 03/18/27	200	0	0	200 EUR	89.46%	178'922.00	0.03	a)
XS1963555617	1.1250 % PEP 1 1/8 03/18/31	100	100	0	200 EUR	83.01%	166'018.00	0.03	a)
XS1963745234	1.6000 % MCD 1.6 03/15/31	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1963836892	1.3490 % MMC 1.349 09/21/26	0	200	0	200 EUR	90.75%	181'502.00	0.03	a)
XS1963837197	1.9790 % MMC 1.979 03/21/30	0	200	0	200 EUR	86.00%	171'996.00	0.03	a)
XS1963849440	1.6250 % DANBNK 1 5/8 03/15/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.64%	195'280.00	0.03	a)
XS1966038249	1.3750 % TLSAU 1 3/8 03/26/29 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1967635977	2.3750 % ABESM 2 3/8 09/27/27 EMTN	500	0	0	500 EUR	92.12%	460'580.00	0.08	a)
XS1967636199	3.0000 % ABESM 3 03/27/31 EMTN	400	0	0	400 EUR	89.27%	357'068.00	0.06	a)
XS1967697738	2.5000 % DANBNK 2 1/2 06/21/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	96.38%	240'937.50	0.04	a)
XS1968706108	2.0000 % ACAFP 2 03/25/29 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1968706520	1.4500 % SCGAU 1.45 03/28/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	82.33%	82'334.00	0.01	a)
XS1968846532	1.1250 % CABKSM 1 1/8 03/27/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.32%	182'640.00	0.03	a)
XS1969600748	1.7500 % CNHI 1 3/4 03/25/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.34%	184'670.00	0.03	a)
XS1972547696	2.2500 % VW 2 1/4 10/01/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.52%	277'566.00	0.05	a)
XS1972548231	1.5000 % VW 1 1/2 10/01/24 EMTN	280	0	0	280 EUR	96.25%	269'488.80	0.05	a)
XS1973750869	1.6250 % BACRED 1 5/8 01/07/25 EMTN	150	0	0	150 EUR	95.70%	143'550.00	0.02	a)
XS1974787480	1.7500 % TTEFP 1 3/4 PERP EMTN	400	0	0	400 EUR	95.75%	383'000.00	0.07	a)
XS1979259220	0.3750 % MET 0 3/8 04/09/24	300	0	0	300 EUR	96.22%	288'663.00	0.05	a)
XS1979262448	0.2500 % DNBNO 0 1/4 04/09/24	0	300	0	300 EUR	96.22%	288'669.00	0.05	a)
XS1979446843	1.5000 % ISPIM 1 1/2 04/10/24 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.39%	243'480.00	0.04	a)
XS1980064833	1.2500 % C 1 1/4 04/10/29 EMTN	600	0	0	600 EUR	84.12%	504'720.00	0.09	a)
XS1980270810	1.0000 % TRNIM 1 04/10/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.36%	184'720.00	0.03	a)
XS1981054221	1.1250 % CCEP 1 1/8 04/12/29	100	0	0	100 EUR	84.93%	84'929.00	0.01	a)
XS1982037696	0.5000 % ABNANV 0 1/2 04/15/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	90.80%	272'400.00	0.05	a)
XS1982107903	0.1250 % DGELN 0 1/8 10/12/23 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1982725159	0.3750 % ERSTBK 0 3/8 04/16/24 EMTN	0	100	0	100 EUR	96.08%	96'084.00	0.02	a)
XS1985806600	0.3750 % TD 0 3/8 04/25/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.19%	288'579.00	0.05	a)
XS1986416698	1.5000 % SIKASW 1 1/2 04/29/31	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1987142673	0.5000 % BNS 0 1/2 04/30/24 EMTN	0	200	0	200 EUR	96.12%	192'238.00	0.03	a)
XS1989708836	3.3750 % ASRND 3 3/8 05/02/49	200	0	0	200 EUR	87.00%	174'000.00	0.03	a)
XS1991125896	0.3750 % CM 0 3/8 05/03/24 EMTN	350	0	0	350 EUR	96.04%	336'154.00	0.06	a)
XS1991126431	1.1250 % RABOBK 1 1/8 05/07/31 GMTN	300	0	0	300 EUR	78.98%	236'928.00	0.04	a)
XS1991190361	1.5000 % CESDRA 1 1/2 05/23/26	200	0	0	200 EUR	89.77%	179'540.00	0.03	a)
XS1991265395	1.3810 % BAC 1.381 05/09/30 EMTN	400	0	0	400 EUR	84.03%	336'128.00	0.06	a)
XS1991265478	0.8080 % BAC 0.808 05/09/26 EMTN	200	150	0	350 EUR	92.99%	325'454.50	0.06	a)
XS1992927902	1.2310 % BPLN 1.231 05/08/31 EMTN	150	150	0	300 EUR	80.07%	240'219.00	0.04	a)
XS1995716211	3.3750 % SAMPFH 3 3/8 05/23/49	0	250	100	150 EUR	89.25%	133'875.00	0.02	a)
XS1996269061	0.6970 % ETN 0.697 05/14/25	150	0	0	150 EUR	93.32%	139'980.00	0.02	a)
XS1996435688	1.0000 % CEP5A 1 02/16/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.71%	189'412.00	0.03	a)
XS1996441066	0.8750 % RTOLN 0 7/8 05/30/26 EMTN	0	150	0	150 EUR	90.53%	135'787.50	0.02	a)
XS1997077364	1.4500 % TCLAU 1.45 05/16/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	86.05%	172'100.00	0.03	a)
XS1998215393	0.4000 % BAX 0.4 05/15/24 EMTN	0	150	0	150 EUR	95.78%	143'662.50	0.02	a)
XS1998215559	1.3000 % BAX 1.3 05/15/29	300	0	0	300 EUR	84.13%	252'384.00	0.04	a)
XS1998797663	0.2500 % NAB 0 1/4 05/20/24 GMTN	0	150	0	150 EUR	95.94%	143'907.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1998798042	1.1250 % NAB 1 1/8 05/20/31 GMTN	200	100	0	300 EUR	83.57%	250'704.00	0.04	a)
XS1998902479	1.9500 % T 1.95 09/15/23	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2000504444	3.6250 % LIBMUT 3 5/8 05/23/59 REGS	150	0	0	150 EUR	93.25%	139'875.00	0.02	a)
XS2000538343	0.8750 % ERSTBK 0 7/8 05/22/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.27%	180'536.00	0.03	a)
XS2000719992	3.5000 % ENELIM 3 1/2 PERP	250	0	0	250 EUR	94.88%	237'187.50	0.04	a)
XS2001175657	0.5000 % PHIANA 0 1/2 05/22/26	200	0	0	200 EUR	89.50%	179'000.00	0.03	a)
XS2001183164	1.5000 % VESTNL 1 1/2 05/24/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.00%	179'998.00	0.03	a)
XS2001737910	1.1250 % TELNO 1 1/8 05/31/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	85.26%	255'792.00	0.04	a)
XS2001738991	1.7500 % TELNO 1 3/4 05/31/34 EMTN	150	0	0	150 EUR	79.63%	119'439.00	0.02	a)
XS2002017361	0.9000 % VOD 0.9 11/24/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.75%	181'506.00	0.03	a)
XS2002018500	1.6250 % VOD 1 5/8 11/24/30 EMTN	0	150	0	150 EUR	84.14%	126'214.50	0.02	a)
XS2002019060	2.5000 % VOD 2 1/2 05/24/39 EMTN	150	100	0	250 EUR	77.47%	193'682.50	0.03	a)
XS2002491517	1.0000 % NWG 1 05/28/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.35%	192'702.00	0.03	a)
XS2002491863	1.5000 % TENN 1 1/2 06/03/39 EMTN	350	0	0	350 EUR	73.22%	256'280.50	0.04	a)
XS2002532567	0.6320 % BDX 0.632 06/04/23	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2002532724	1.2080 % BDX 1.208 06/04/26	200	0	0	200 EUR	91.62%	183'234.00	0.03	a)
XS2003442436	1.2500 % AIB 1 1/4 05/28/24 EMTN	250	0	0	250 EUR	96.69%	241'722.50	0.04	a)
XS2003499386	0.3750 % NDASS 0 3/8 05/28/26 EMTN	0	150	0	150 EUR	90.44%	135'666.00	0.02	a)
XS2004381245	1.5350 % TTEFP 1.535 05/31/39 EMTN	200	0	0	200 EUR	71.48%	142'964.00	0.02	a)
XS2004381674	0.6960 % TTEFP 0.696 05/31/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	85.75%	85'745.00	0.01	a)
XS2004880832	0.5230 % MIZUHO 0.523 06/10/24 EMTN	0	500	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2006277508	0.7500 % AMXLMM 0 3/4 06/26/27 EMTN	0	500	0	500 EUR	88.08%	440'400.00	0.08	a)
XS2006909407	1.3750 % BRTFOD 1 3/8 06/19/24	0	100	0	100 EUR	94.53%	94'530.00	0.02	a)
XS2008921947	0.6250 % AEGON 0 5/8 06/21/24	200	0	0	200 EUR	95.51%	191'012.00	0.03	a)
XS2008925344	1.5000 % UNANA 1 1/2 06/11/39	0	100	0	100 EUR	73.36%	73'359.00	0.01	a)
XS2009861480	1.1250 % ESBIRE 1 1/8 06/11/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	83.26%	208'155.00	0.04	a)
XS2009891479	0.5000 % VATFAL 0 1/2 06/24/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.12%	180'242.00	0.03	a)
XS2010032378	0.2500 % ASML 0 1/4 02/25/30	0	250	0	250 EUR	80.28%	200'702.50	0.03	a)
XS2010036874	1.7500 % ORSTED 1 3/4 12/09/3019	150	0	0	150 EUR	85.13%	127'687.50	0.02	a)
XS2010038227	0.9500 % MCO 0.95 02/25/30	0	250	0	250 EUR	82.69%	206'712.50	0.04	a)
XS2010038730	0.7500 % DOV 0 3/4 11/04/27	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2010044209	0.5000 % SLB 0 1/2 10/15/31	280	0	280	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2010045198	0.2500 % SLB 0 1/4 10/15/27	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2010045271	0.0000 % SLB 0 10/15/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2010045511	2.1250 % NGGLN 2 1/8 09/05/2082	250	0	0	250 EUR	85.13%	212'812.50	0.04	a)
XS2010331101	1.6500 % DE 1.65 06/13/39 EMTN	250	0	0	250 EUR	77.34%	193'340.00	0.03	a)
XS2010447238	0.7500 % BMW 0 3/4 07/13/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.83%	183'666.00	0.03	a)
XS2011260531	1.6250 % MRKGR 1 5/8 06/25/2079	200	0	0	200 EUR	94.50%	189'000.00	0.03	a)
XS2011260705	2.8750 % MRKGR 2 7/8 06/25/2079	300	0	0	300 EUR	88.88%	266'625.00	0.05	a)
XS2012047127	0.3750 % BZLNZ 0 3/8 09/14/24 GMTN	250	0	0	250 EUR	94.71%	236'765.00	0.04	a)
XS2013539635	1.0000 % SGTOPT 1 06/20/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	81.81%	81'806.00	0.01	a)
XS2013574038	1.3750 % CABKSM 1 3/8 06/19/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	90.91%	363'648.00	0.06	a)
XS2013618421	0.8750 % ISSDC 0 7/8 06/18/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.94%	177'872.00	0.03	a)
XS2013626010	1.6250 % ZURNVX 1 5/8 06/17/39 EMTN	200	0	0	200 EUR	71.93%	143'856.00	0.02	a)
XS2013745703	1.0000 % BBVASM 1 06/21/26	300	300	300	300 EUR	91.25%	273'738.00	0.05	a)
XS2014287937	0.2500 % SANTAN 0 1/4 06/19/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.45%	190'894.00	0.03	a)
XS2014288158	0.3750 % OPBANK 0 3/8 06/19/24 EMTN	150	0	0	150 EUR	95.40%	143'094.00	0.02	a)
XS2014291616	1.5000 % VW 1 1/2 06/19/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.76%	183'510.00	0.03	a)
XS2015240083	1.5000 % SEGPLP 1 1/2 12/20/26	200	0	0	200 EUR	88.10%	176'190.00	0.03	a)
XS2015267953	0.6250 % PSABFR 0 5/8 06/21/24	150	0	0	150 EUR	95.72%	143'575.50	0.02	a)
XS2015314037	2.6250 % ISPIM 2 5/8 06/20/24 EMTN	250	0	0	250 EUR	98.27%	245'682.50	0.04	a)
XS2017471553	1.2500 % UCGIM 1 1/4 06/25/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	95.97%	383'888.00	0.07	a)
XS2018636600	0.2500 % ADNA 0 1/4 06/26/25	200	0	0	200 EUR	92.43%	184'854.00	0.03	a)
XS2018637913	0.3750 % SANSFCF 0 3/8 06/27/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.42%	286'266.00	0.05	a)
XS2020568734	0.0500 % SEB 0.05 07/01/24 EMTN	300	100	0	400 EUR	95.18%	380'700.00	0.07	a)
XS2020583618	1.9570 % TELEFO 1.957 07/01/39	0	200	0	200 EUR	73.27%	146'534.00	0.03	a)
XS2020670779	0.2500 % MDT 0 1/4 07/02/25	400	0	0	400 EUR	92.42%	369'676.00	0.06	a)
XS2020670852	1.0000 % MDT 1 07/02/31	300	0	0	300 EUR	79.94%	239'808.00	0.04	a)
XS2020670936	1.5000 % MDT 1 1/2 07/02/39	300	0	0	300 EUR	68.05%	204'147.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2020671157	1.7500 % MDT 1 3/4 07/02/49	350	0	0	350 EUR	60.53%	211'851.50	0.04	a)
XS2021467753	0.9000 % STANLN 0.9 07/02/27 EMTN	150	0	0	150 EUR	89.05%	133'573.50	0.02	a)
XS2021471433	0.3750 % MOTOPG 0 3/8 01/03/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	91.04%	227'595.00	0.04	a)
XS2021993212	1.6250 % UCGIM 1 5/8 07/03/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	96.63%	241'562.50	0.04	a)
XS2022084367	1.6250 % CNHI 1 5/8 07/03/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.77%	173'532.00	0.03	a)
XS2022093434	0.0000 % OMVAV 0 07/03/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.82%	183'638.00	0.03	a)
XS2022093517	1.0000 % OMVAV 1 07/03/34 EMTN	150	0	0	150 EUR	72.03%	108'039.00	0.02	a)
XS2022424993	1.7500 % ISPIM 1 3/4 07/04/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	84.31%	252'930.00	0.04	a)
XS2022425297	1.0000 % ISPIM 1 07/04/24 EMTN	350	0	0	350 EUR	96.06%	336'224.00	0.06	a)
XS2023633931	0.7500 % BKIR 0 3/4 07/08/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2023644201	0.3750 % MRKGR 0 3/8 07/05/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.80%	175'590.00	0.03	a)
XS2023644540	0.8750 % MRKGR 0 7/8 07/05/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	81.11%	243'315.00	0.04	a)
XS2024715794	0.5000 % DT 0 1/2 07/05/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.79%	177'578.00	0.03	a)
XS2024716099	1.3750 % DT 1 3/8 07/05/34 EMTN	0	100	0	100 EUR	77.82%	77'823.00	0.01	a)
XS2025466413	0.6250 % ABESM 0 5/8 07/15/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.40%	184'798.00	0.03	a)
XS2027364244	0.7500 % LOGICR 0 3/4 07/15/24 EMTN	250	0	0	250 EUR	93.32%	233'302.50	0.04	a)
XS2027364327	1.6250 % LOGICR 1 5/8 07/15/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	83.60%	250'809.00	0.04	a)
XS2027957815	1.1250 % BACRED 1 1/8 07/15/25 EMTN	150	0	0	150 EUR	93.52%	140'284.50	0.02	a)
XS2028816028	0.8750 % SABSM 0 7/8 07/22/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.83%	278'493.00	0.05	a)
XS2029574634	0.3750 % ALDFP 0 3/8 07/18/23 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2031862076	0.1250 % RY 0 1/8 07/23/24	350	0	0	350 EUR	95.13%	332'951.50	0.06	a)
XS2032727310	0.8750 % IGIM 0 7/8 04/24/30 EMTN	150	0	0	150 EUR	79.60%	119'394.00	0.02	a)
XS2034626460	0.4500 % FDX 0.45 08/05/25	0	200	0	200 EUR	92.58%	185'154.00	0.03	a)
XS2034629134	1.3000 % FDX 1.3 08/05/31	0	200	0	200 EUR	79.18%	158'366.00	0.03	a)
XS2035564629	1.6250 % ENBW 1 5/8 08/05/2079	200	0	0	200 EUR	84.13%	168'250.00	0.03	a)
XS2035564975	1.1250 % ENBW 1 1/8 11/05/2079	100	0	0	100 EUR	92.88%	92'875.00	0.02	a)
XS2035620710	0.2500 % REPSM 0 1/4 08/02/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.46%	172'920.00	0.03	a)
XS2038039074	0.5800 % BAC 0.58 08/08/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	81.91%	245'736.00	0.04	a)
XS2042667944	0.6250 % KYGID 0 5/8 09/20/29	250	0	0	250 EUR	81.94%	204'855.00	0.04	a)
XS2043678841	0.1250 % GS 0 1/8 08/19/24 EMTN	337	0	0	337 EUR	94.89%	319'762.45	0.06	a)
XS2046595836	0.5000 % DANBNK 0 1/2 08/27/25	100	150	0	250 EUR	94.13%	235'312.50	0.04	a)
XS2047500926	0.3500 % EOANGR 0.35 02/28/30 EMTN	0	300	0	300 EUR	79.25%	237'735.00	0.04	a)
XS2049090595	0.1250 % VGASDE 0 1/8 09/10/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.67%	157'332.00	0.03	a)
XS2049146215	0.5000 % VGASDE 0 1/2 09/10/34 EMTN	200	0	0	200 EUR	67.33%	134'658.00	0.02	a)
XS2049154078	0.1000 % INTNED 0.1 09/03/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.75%	281'250.00	0.05	a)
XS2049583607	0.6250 % PLD 0 5/8 09/10/31	0	150	0	150 EUR	73.57%	110'361.00	0.02	a)
XS2049583789	1.5000 % PLD 1 1/2 09/10/49	0	100	0	100 EUR	57.07%	57'067.00	0.01	a)
XS2049616548	0.0000 % SIEGR 0 09/05/24	200	0	0	200 EUR	94.98%	189'964.00	0.03	a)
XS2049616621	0.1250 % SIEGR 0 1/8 09/05/29	400	0	0	400 EUR	82.38%	329'512.00	0.06	a)
XS2049616894	0.5000 % SIEGR 0 1/2 09/05/34 EMTN	300	0	0	300 EUR	71.69%	215'064.00	0.04	a)
XS2049630028	0.4020 % MIZUHO 0.402 09/06/29 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2049630887	0.1180 % MIZUHO 0.118 09/06/24 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2049707180	0.1250 % BNS 0 1/8 09/04/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	87.37%	262'098.00	0.05	a)
XS2049769297	0.8750 % MOLNLY 0 7/8 09/05/29 EMTN	150	0	0	150 EUR	81.95%	122'922.00	0.02	a)
XS2049823763	1.5000 % RBAIV 1 1/2 03/12/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.00%	170'000.00	0.03	a)
XS2050404636	0.2000 % DHR 0.2 03/18/26	300	100	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2050404800	0.4500 % DHR 0.45 03/18/28	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2050406094	0.7500 % DHR 0 3/4 09/18/31	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2050406177	1.3500 % DHR 1.35 09/18/39	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2050543839	1.3750 % ITVLN 1 3/8 09/26/26	250	0	0	250 EUR	90.84%	227'100.00	0.04	a)
XS2050945984	0.1250 % SCBNOR 0 1/8 09/11/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.98%	187'952.00	0.03	a)
XS2050968333	1.5000 % SKGID 1 1/2 09/15/27	200	0	0	200 EUR	89.99%	179'970.00	0.03	a)
XS2051149552	1.8000 % DHR 1.8 09/18/49	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2051361264	0.2500 % T 0 1/4 03/04/26	0	300	0	300 EUR	89.90%	269'709.00	0.05	a)
XS2051362072	0.8000 % T 0.8 03/04/30	300	0	0	300 EUR	80.12%	240'363.00	0.04	a)
XS2051362312	1.8000 % T 1.8 09/14/39	0	100	0	100 EUR	68.57%	68'566.00	0.01	a)
XS2051494222	0.5000 % BRITEL 0 1/2 09/12/25 EMTN	150	0	0	150 EUR	92.02%	138'034.50	0.02	a)
XS2051494495	1.1250 % BRITEL 1 1/8 09/12/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	83.90%	167'794.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2051659915	0.1250 % LPTY 0 1/8 09/13/23 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2051660335	0.0000 % SRGIM 0 05/12/24	250	0	0	250 EUR	95.48%	238'705.00	0.04 a)	
XS2051660509	1.0000 % SRGIM 1 09/12/34 EMTN	200	0	0	200 EUR	70.23%	140'454.00	0.02 a)	
XS2051664675	1.3750 % BABLN 1 3/8 09/13/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	85.39%	170'786.00	0.03 a)	
XS2051777873	0.8750 % SMDSLN 0 7/8 09/12/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	89.25%	223'127.50	0.04 a)	
XS2051914963	0.5000 % FCABNK 0 1/2 09/13/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.34%	283'032.00	0.05 a)	
XS2052310054	0.8750 % LYB 0 7/8 09/17/26	0	150	0	150 EUR	89.12%	133'684.50	0.02 a)	
XS2052313827	1.6250 % LYB 1 5/8 09/17/31	0	200	0	200 EUR	80.50%	160'994.00	0.03 a)	
XS2052968596	1.3500 % WPC 1.35 04/15/28	100	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2052998403	0.3750 % ANZNZ 0 3/8 09/17/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.86%	157'728.00	0.03 a)	
XS2053052895	0.3750 % EDPL 0 3/8 09/16/26 EMTN	0	400	0	400 EUR	88.84%	355'360.00	0.06 a)	
XS2054209320	0.4520 % WNTRDE 0.452 09/25/23	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2054209833	0.8400 % WNTRDE 0.84 09/25/25	300	0	0	300 EUR	91.78%	275'343.00	0.05 a)	
XS2054210252	1.3320 % WNTRDE 1.332 09/25/28	300	0	0	300 EUR	83.34%	250'032.00	0.04 a)	
XS2055079904	1.8230 % WNTRDE 1.823 09/25/31	300	0	0	300 EUR	78.05%	234'141.00	0.04 a)	
XS2055089457	2.0000 % UCGIM 2 09/23/29 EMTN	400	0	0	400 EUR	93.13%	372'500.00	0.06 a)	
XS2055104785	0.5000 % ASBBNK 0 1/2 09/24/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.27%	156'534.00	0.03 a)	
XS2055627538	0.3750 % RBAIV 0 3/8 09/25/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.26%	170'512.00	0.03 a)	
XS2055647213	1.2500 % ABBV 1 1/4 11/18/31	100	0	0	100 EUR	81.74%	81'737.00	0.01 a)	
XS2055651918	1.1250 % ABESM 1 1/8 03/26/28	300	0	0	300 EUR	85.49%	256'473.00	0.04 a)	
XS2055652056	1.8750 % ABESM 1 7/8 03/26/32	200	0	0	200 EUR	80.29%	160'574.00	0.03 a)	
XS2056374353	0.8750 % MDLZ 0 7/8 10/01/31 REGS	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2056399855	0.6250 % TELNO 0 5/8 09/25/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	76.56%	153'122.00	0.03 a)	
XS2056400299	0.6250 % WFC 0 5/8 03/25/30 EMTN	0	300	0	300 EUR	78.35%	235'044.00	0.04 a)	
XS2056430874	0.3750 % CONGR 0 3/8 06/27/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2056491587	2.1240 % ASSGEN 2.124 10/01/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	82.99%	165'980.00	0.03 a)	
XS2058729653	0.3750 % BBVASM 0 3/8 10/02/24 EMTN	300	300	300	300 EUR	94.60%	283'788.00	0.05 a)	
XS2062490649	2.0450 % ENAPHO 2.045 10/09/28	200	0	0	200 EUR	73.69%	147'372.00	0.03 a)	
XS2063232727	0.5000 % C 0 1/2 10/08/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	87.52%	350'060.00	0.06 a)	
XS2063246198	1.3750 % AMCOSP 1 3/8 01/27/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.72%	189'444.00	0.03 a)	
XS2063247915	0.3000 % SANTAN 0.3 10/04/26 EMTN	500	0	0	500 EUR	87.91%	439'540.00	0.08 a)	
XS2063261155	0.2500 % SWEDA 0 1/4 10/09/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.24%	188'476.00	0.03 a)	
XS2063350925	1.1250 % HANRUE 1 1/8 10/09/39	0	200	0	200 EUR	77.88%	155'750.00	0.03 a)	
XS2063495811	1.1250 % DLR 1 1/8 04/09/28	200	0	0	200 EUR	82.86%	165'722.00	0.03 a)	
XS2063535970	1.8750 % NEPSJ 1 7/8 10/09/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.37%	172'736.00	0.03 a)	
XS2063659945	0.2500 % SCBGER 0 1/4 10/15/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.77%	187'538.00	0.03 a)	
XS2064302735	0.8750 % PEP 0 7/8 10/16/39	200	0	0	200 EUR	65.44%	130'878.00	0.02 a)	
XS2065593068	0.2500 % RFLBNI 0 1/4 04/16/24 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.55%	191'108.00	0.03 a)	
XS2065946837	1.0000 % ENIIM 1 10/11/34 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2066706818	0.0000 % ENELIM 0 06/17/24 EMTN	0	150	0	150 EUR	95.07%	142'608.00	0.02 a)	
XS2066706909	0.3750 % ENELIM 0 3/8 06/17/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.76%	171'528.00	0.03 a)	
XS2067135421	0.3750 % ACAFP 0 3/8 10/21/25 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2067213913	1.6250 % ISPIM 1 5/8 04/21/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.63%	236'562.50	0.04 a)	
XS2068065163	1.2500 % INFLN 1 1/4 04/22/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.03%	170'050.00	0.03 a)	
XS2069380991	0.2500 % EOANGR 0 1/4 10/24/26 EMTN	0	250	0	250 EUR	89.26%	223'142.50	0.04 a)	
XS2069407786	1.6250 % CPIPGR 1 5/8 04/23/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	75.83%	189'582.50	0.03 a)	
XS2070192591	0.6250 % BSX 0 5/8 12/01/27	300	0	0	300 EUR	86.26%	258'768.00	0.04 a)	
XS2071382662	1.1250 % VCXAU 1 1/8 11/07/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	78.78%	157'556.00	0.03 a)	
XS2075937370	0.6250 % LLY 0 5/8 11/01/31	200	0	0	200 EUR	78.33%	156'658.00	0.03 a)	
XS2075938006	1.7000 % LLY 1.7 11/01/49	300	0	0	300 EUR	66.06%	198'186.00	0.03 a)	
XS2076079594	0.6250 % SABSM 0 5/8 11/07/25	100	0	0	100 EUR	94.25%	94'250.00	0.02 a)	
XS2076154801	0.1000 % ABT 0.1 11/19/24	200	0	0	200 EUR	94.04%	188'074.00	0.03 a)	
XS2076155105	0.3750 % ABT 0 3/8 11/19/27	150	0	0	150 EUR	86.71%	130'066.50	0.02 a)	
XS2077546682	0.6250 % EOANGR 0 5/8 11/07/31 EMTN	0	150	0	150 EUR	76.19%	114'280.50	0.02 a)	
XS2078409716	0.8750 % CL 0 7/8 11/12/39 EMTN	150	0	0	150 EUR	69.45%	104'173.50	0.02 a)	
XS2078667925	0.6250 % OPBANK 0 5/8 11/12/29 EMTN	0	150	0	150 EUR	78.57%	117'850.50	0.02 a)	
XS2078692105	0.5000 % SANSCF 0 1/2 11/14/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.77%	175'540.00	0.03 a)	
XS2078734626	0.1250 % RDSALN 0 1/8 11/08/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	85.16%	255'477.00	0.04 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2078735276	0.5000 % RDSALN 0 1/2 11/08/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	75.67%	151'340.00	0.03	a)
XS2078735433	0.8750 % RDSALN 0 7/8 11/08/39 EMTN	350	0	0	350 EUR	60.33%	211'144.50	0.04	a)
XS2078737215	0.6250 % SEB 0 5/8 11/12/29 EMTN	350	0	0	350 EUR	79.94%	279'790.00	0.05	a)
XS2078761785	1.3750 % DANBNK 1 3/8 02/12/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.25%	276'750.00	0.05	a)
XS2078918781	0.5000 % LLOYDS 0 1/2 11/12/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.13%	235'332.50	0.04	a)
XS2079079799	1.0000 % INTNED 1 11/13/30	300	0	0	300 EUR	88.88%	266'625.00	0.05	a)
XS2079105891	1.1640 % ZBH 1.164 11/15/27	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2079678400	0.5000 % STEDIN 0 1/2 11/14/29 EMTN	150	0	0	150 EUR	81.41%	122'109.00	0.02	a)
XS2079713322	0.3750 % BBVASM 0 3/8 11/15/26 GMTN	300	300	300	300 EUR	87.84%	263'529.00	0.05	a)
XS2079716937	0.5000 % AAPL 0 1/2 11/15/31	0	450	150	300 EUR	78.11%	234'339.00	0.04	a)
XS2079723552	0.0500 % DNBNO 0.05 11/14/23 EMTN	0	500	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2080205367	0.7500 % NWG 0 3/4 11/15/25	250	0	0	250 EUR	94.17%	235'415.00	0.04	a)
XS2080581189	0.1250 % HESLAN 0 1/8 11/19/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.03%	282'102.00	0.05	a)
XS2080767010	1.8750 % AIB 1 7/8 11/19/29 EMTN	150	0	0	150 EUR	93.38%	140'062.50	0.02	a)
XS2080785343	0.5000 % TEMASE 0 1/2 11/20/31 GMTN	200	0	0	200 EUR	76.20%	152'408.00	0.03	a)
XS2080786150	1.2500 % TEMASE 1 1/4 11/20/49 GMTN	150	0	0	150 EUR	62.43%	93'642.00	0.02	a)
XS2081016763	1.1040 % BPLN 1.104 11/15/34	300	0	0	300 EUR	71.51%	214'527.00	0.04	a)
XS2081018629	1.0000 % ISPIM 1 11/19/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.15%	267'444.00	0.05	a)
XS2082324018	1.7500 % MTNA 1 3/4 11/19/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	93.59%	233'970.00	0.04	a)
XS2082324364	0.7500 % BACR 0 3/4 06/09/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.57%	191'138.00	0.03	a)
XS2082333787	0.3000 % DEKA 0.3 11/20/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.78%	175'566.00	0.03	a)
XS2082345955	0.6250 % CCHLN 0 5/8 11/21/29	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2082429890	1.3750 % TELIAS 1 3/8 05/11/2081	0	150	0	150 EUR	88.38%	132'562.50	0.02	a)
XS2082472122	1.0000 % JAPTOB 1 11/26/29	200	150	200	150 EUR	79.03%	118'548.00	0.02	a)
XS2082818951	1.1250 % ANZ 1 1/8 11/21/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.38%	280'125.00	0.05	a)
XS2082969655	1.0000 % BKIR 1 11/25/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.62%	236'552.50	0.04	a)
XS2083147343	1.6250 % ALB 1 5/8 11/25/28	200	200	200	200 EUR	87.13%	174'250.00	0.03	a)
XS2083210729	1.0000 % ERSTBK 1 06/10/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.71%	179'414.00	0.03	a)
XS2084050637	0.3750 % NNGRNV 0 3/8 02/26/25	100	0	0	100 EUR	92.75%	92'753.00	0.02	a)
XS2084488209	1.2500 % FMEGR 1 1/4 11/29/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	78.63%	78'634.00	0.01	a)
XS2084497705	0.6250 % FMEGR 0 5/8 11/30/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	88.06%	220'137.50	0.04	a)
XS2084510069	0.2500 % FMEGR 0 1/4 11/29/23 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS20866868010	0.8750 % TSCOLN 0 7/8 05/29/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.51%	181'020.00	0.03	a)
XS2087622069	0.2500 % SYK 0 1/4 12/03/24	0	400	0	400 EUR	94.04%	376'172.00	0.06	a)
XS2087639626	0.7500 % SYK 0 3/4 03/01/29	0	300	0	300 EUR	83.47%	250'413.00	0.04	a)
XS2087643651	1.0000 % SYK 1 12/03/31	0	300	0	300 EUR	77.90%	233'706.00	0.04	a)
XS2089226026	1.7500 % DT 1 3/4 12/09/49 EMTN	200	0	0	200 EUR	65.44%	130'872.00	0.02	a)
XS2089368596	0.7500 % ISPIM 0 3/4 12/04/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.67%	284'022.00	0.05	a)
XS2090859252	0.8750 % BACRED 0 7/8 01/15/26	200	0	0	200 EUR	91.70%	183'400.00	0.03	a)
XS2099128055	0.8750 % CAIAV 0 7/8 02/05/27	0	200	0	200 EUR	81.49%	162'984.00	0.03	a)
XS2099546488	0.8750 % ACAFP 0 7/8 01/14/32 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2100663579	0.6250 % DLR 0 5/8 07/15/25	250	0	0	250 EUR	90.49%	226'222.50	0.04	a)
XS2100664114	1.5000 % DLR 1 1/2 03/15/30	200	0	0	200 EUR	80.47%	160'948.00	0.03	a)
XS2100690036	0.3750 % SANSFC 0 3/8 01/17/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	93.48%	373'932.00	0.06	a)
XS2100788780	0.4500 % GIS 0.45 01/15/26	250	0	0	250 EUR	90.90%	227'242.50	0.04	a)
XS2101349723	0.5000 % BBVASM 0 1/2 01/14/27 GMTN	400	400	400	400 EUR	86.73%	346'904.00	0.06	a)
XS2101357072	0.7500 % FREGR 0 3/4 01/15/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	84.48%	211'207.50	0.04	a)
XS2101558307	2.7310 % UCGIM 2.731 01/15/32	350	0	0	350 EUR	86.13%	301'437.50	0.05	a)
XS2102283061	0.6000 % ABNAV 0.6 01/15/27	300	0	0	300 EUR	87.74%	263'205.00	0.05	a)
XS2102357014	0.3750 % BMW 0 3/8 01/14/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.43%	178'868.00	0.03	a)
XS2102357105	0.8750 % BMW 0 7/8 01/14/32 EMTN	150	0	0	150 EUR	80.30%	120'454.50	0.02	a)
XS2102360315	0.8500 % STANLN 0.85 01/27/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.17%	174'332.00	0.03	a)
XS2102916793	0.1250 % MRKGR 0 1/8 07/16/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.27%	184'530.00	0.03	a)
XS2102924383	0.6000 % OPBANK 0.6 01/18/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	87.29%	218'235.00	0.04	a)
XS2102931594	0.3750 % CABKSM 0 3/8 02/03/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.36%	280'074.00	0.05	a)
XS2102932055	0.5000 % MRKGR 0 1/2 07/16/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.74%	171'474.00	0.03	a)
XS2103013210	0.3750 % REESM 0 3/8 07/24/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	85.74%	257'226.00	0.04	a)
XS2103014291	0.3750 % EOANGR 0 3/8 09/29/27 EMTN	0	500	0	500 EUR	87.34%	436'685.00	0.08	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2103230152	0.5000 % POHANG 0 1/2 01/17/24 REGS	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2104051433	1.0000 % BBVASM 1 01/16/30 GMTN	300	300	300	300 EUR	91.50%	274'500.00	0.05	a)
XS2104915033	0.1900 % NGGLN 0.19 01/20/25	0	300	0	300 EUR	93.30%	279'894.00	0.05	a)
XS2104967695	1.2000 % UCGIM 1.2 01/20/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.75%	281'250.00	0.05	a)
XS2104968404	1.8000 % UCGIM 1.8 01/20/30	250	0	0	250 EUR	81.46%	203'660.00	0.04	a)
XS2105772201	1.1250 % HEIBOS 1 1/8 01/21/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	85.95%	257'841.00	0.04	a)
XS2106056653	0.2500 % RBAV 0 1/4 01/22/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.57%	183'132.00	0.03	a)
XS2106861771	1.1250 % BACRED 1 1/8 04/23/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.14%	235'347.50	0.04	a)
XS2107315470	0.6250 % ENIIM 0 5/8 01/23/30 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2107332640	0.8750 % GS 0 7/8 01/21/30 EMTN	400	0	0	400 EUR	79.76%	319'056.00	0.05	a)
XS2107435617	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 01/23/27 GMTN	250	0	0	250 EUR	87.45%	218'612.50	0.04	a)
XS2108490090	0.8750 % PSA 0 7/8 01/24/32	0	300	150	150 EUR	73.86%	110'787.00	0.02	a)
XS2109394077	0.3750 % LLOYDS 0 3/8 01/28/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.49%	93'492.00	0.02	a)
XS2109806369	0.2500 % FCABNK 0 1/4 02/28/23 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2112289207	0.6640 % TELEFO 0.664 02/03/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	81.46%	244'371.00	0.04	a)
XS2112475921	1.0000 % PLD 1 02/06/35	300	0	0	300 EUR	68.75%	206'241.00	0.04	a)
XS2113700921	0.5000 % ACEIM 0 1/2 04/06/29 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2113889351	0.5000 % SANTAN 0 1/2 02/04/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	86.51%	259'539.00	0.04	a)
XS2113911387	1.2500 % ABESM 1 1/4 02/07/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.48%	172'950.00	0.03	a)
XS2114852218	0.2500 % CMCSA 0 1/4 05/20/27	283	0	0	283 EUR	86.24%	244'070.52	0.04	a)
XS2114852564	0.7500 % CMCSA 0 3/4 02/20/32	447	0	0	447 EUR	76.26%	340'868.79	0.06	a)
XS2114852721	1.2500 % CMCSA 1 1/4 02/20/40	219	0	0	219 EUR	66.71%	146'097.09	0.03	a)
XS2115091717	0.3000 % IBM 0.3 02/11/28	400	0	0	400 EUR	84.54%	338'176.00	0.06	a)
XS2115091808	0.6500 % IBM 0.65 02/11/32	400	0	0	400 EUR	75.22%	300'888.00	0.05	a)
XS2115092012	1.2000 % IBM 1.2 02/11/40	300	0	0	300 EUR	64.63%	193'890.00	0.03	a)
XS2115092954	0.5000 % WHR 0 1/2 02/20/28	250	0	0	250 EUR	83.95%	209'882.50	0.04	a)
XS2115094737	0.3750 % SEB 0 3/8 02/11/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	86.67%	346'676.00	0.06	a)
XS2116701348	0.7500 % CDTFIN 0 3/4 03/11/32 EMTN	150	0	0	150 EUR	73.54%	110'316.00	0.02	a)
XS2117454871	0.8750 % TELNO 0 7/8 02/14/35 EMTN	200	0	0	200 EUR	71.19%	142'374.00	0.02	a)
XS2117485677	0.7500 % CEPESA 0 3/4 02/12/28 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2118204200	0.6250 % WFC 0 5/8 08/14/30	0	250	0	250 EUR	77.09%	192'717.50	0.03	a)
XS2118213888	0.6250 % ANVAU 0 5/8 08/25/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	77.39%	154'772.00	0.03	a)
XS2118273601	0.5000 % SIEGR 0 1/2 02/20/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	76.60%	153'208.00	0.03	a)
XS2118276026	0.2500 % SIEGR 0 1/4 02/20/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	82.71%	165'420.00	0.03	a)
XS2118280218	0.0000 % SIEGR 0 02/20/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	90.16%	360'652.00	0.06	a)
XS2122377281	0.1250 % LANSBK 0 1/8 02/19/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.22%	184'438.00	0.03	a)
XS2122485845	0.5000 % DOW 0 1/2 03/15/27	350	600	350	600 EUR	86.40%	518'406.00	0.09	a)
XS2122486066	1.1250 % DOW 1 1/8 03/15/32	300	200	0	500 EUR	75.89%	379'460.00	0.07	a)
XS2122933695	1.8750 % DOW 1 7/8 03/15/40	200	0	0	200 EUR	65.29%	130'572.00	0.02	a)
XS2123970167	0.2500 % VFC 0 1/4 02/25/28	200	200	200	200 EUR	82.61%	165'216.00	0.03	a)
XS2123970241	0.6250 % VFC 0 5/8 02/25/32	200	150	200	150 EUR	73.21%	109'809.00	0.02	a)
XS2125145867	0.8500 % GM 0.85 02/26/26	200	0	0	200 EUR	90.37%	180'732.00	0.03	a)
XS2125426796	0.3750 % DSVDC 0 3/8 02/26/27	150	0	0	150 EUR	87.31%	130'957.50	0.02	a)
XS2125914593	1.2500 % ABBV 1 1/4 06/01/24	250	0	0	250 EUR	96.70%	241'742.50	0.04	a)
XS2125914916	2.1250 % ABBV 2 1/8 06/01/29	250	0	0	250 EUR	90.26%	225'642.50	0.04	a)
XS2126161681	0.0000 % RELN 0 03/18/24	250	0	0	250 EUR	96.19%	240'462.50	0.04	a)
XS2126161764	0.5000 % RELN 0 1/2 03/10/28	300	0	0	300 EUR	85.42%	256'257.00	0.04	a)
XS2126162069	0.8750 % RELN 0 7/8 03/10/32	200	0	0	200 EUR	78.20%	156'404.00	0.03	a)
XS2126170161	1.6250 % GIVNVX 1 5/8 04/22/32	0	150	0	150 EUR	82.18%	123'273.00	0.02	a)
XS2128498636	2.0000 % LIGHT 2 05/11/24	200	0	0	200 EUR	97.37%	194'734.00	0.03	a)
XS2128499105	2.3750 % LIGHT 2 3/8 05/11/27	200	0	0	200 EUR	92.72%	185'432.00	0.03	a)
XS2133071774	0.6250 % CARLB 0 5/8 03/09/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	79.88%	199'687.50	0.03	a)
XS2135797202	1.8760 % BPLN 1.876 04/07/24	0	100	0	100 EUR	98.01%	98'013.00	0.02	a)
XS2135799679	2.5190 % BPLN 2.519 04/07/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	93.16%	232'902.50	0.04	a)
XS2135801160	2.8220 % BPLN 2.822 04/07/32	400	0	0	400 EUR	89.85%	359'416.00	0.06	a)
XS2147133495	1.2500 % UNANA 1 1/4 03/25/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.51%	191'016.00	0.03	a)
XS2147133578	1.7500 % UNANA 1 3/4 03/25/30	300	0	0	300 EUR	89.14%	267'429.00	0.05	a)
XS2147889427	1.8750 % DGELN 1 7/8 03/27/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.52%	187'044.00	0.03	a)
XS2147889690	2.5000 % DGELN 2 1/2 03/27/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	90.77%	272'316.00	0.05	a)
XS2147977636	2.2500 % HEIANA 2 1/4 03/30/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	90.58%	226'457.50	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2147994995	1.7000 % DHR 1.7 03/30/24	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2147995299	2.1000 % DHR 2.1 09/30/26	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2147995372	2.5000 % DHR 2 1/2 03/30/30	150	100	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2148370211	3.6480 % BAC 3.648 03/31/29 EMTN	500	0	0	500 EUR	96.95%	484'735.00	0.08 a)	
XS2148372696	1.1250 % NESNVX 1 1/8 04/01/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.87%	187'730.00	0.03 a)	
XS2148390755	1.5000 % NESNVX 1 1/2 04/01/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	88.11%	220'282.50	0.04 a)	
XS2148623106	3.5000 % LLOYDS 3 1/2 04/01/26 EMTN	350	0	0	350 EUR	98.53%	344'862.00	0.06 a)	
XS2149207354	3.3750 % GS 3 3/8 03/27/25	605	0	0	605 EUR	99.15%	599'869.60	0.10 a)	
XS2149280948	2.0000 % BERTEL 2 04/01/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.92%	183'832.00	0.03 a)	
XS2149368529	1.3750 % PHIANA 1 3/8 03/30/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2149379211	2.0000 % PHIANA 2 03/30/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.51%	173'026.00	0.03 a)	
XS2150006133	1.3750 % DE 1 3/8 04/02/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.81%	293'424.00	0.05 a)	
XS2150006307	1.8500 % DE 1.85 04/02/28	150	0	0	150 EUR	92.32%	138'475.50	0.02 a)	
XS2150006562	2.2000 % DE 2.2 04/02/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.43%	180'860.00	0.03 a)	
XS2150006646	2.7500 % NWG 2 3/4 04/02/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.22%	291'666.00	0.05 a)	
XS2150054026	3.3750 % BACR 3 3/8 04/02/25 EMTN	650	0	0	650 EUR	99.13%	644'312.50	0.11 a)	
XS2151059206	2.3750 % MNDILN 2 3/8 04/01/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.72%	183'430.00	0.03 a)	
XS2151069775	2.3750 % LLOYDS 2 3/8 04/09/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	95.54%	238'845.00	0.04 a)	
XS2152061904	3.3750 % VW 3 3/8 04/06/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	95.70%	239'245.00	0.04 a)	
XS2152062209	3.0000 % VW 3 04/06/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	98.42%	246'057.50	0.04 a)	
XS2152329053	1.6250 % FREGR 1 5/8 10/08/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.95%	177'904.00	0.03 a)	
XS2152883406	3.0000 % TCLAU 3 04/08/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.72%	278'145.00	0.05 a)	
XS2152902719	0.7970 % CHGRID 0.797 08/05/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	88.80%	222'010.00	0.04 a)	
XS2152935214	1.3030 % CHGRID 1.303 08/05/32 EMTN	150	0	0	150 EUR	73.01%	109'515.00	0.02 a)	
XS2153405118	0.8750 % IBESM 0 7/8 06/16/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.06%	188'118.00	0.03 a)	
XS2153406868	1.4910 % TTEFP 1.491 04/08/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	91.76%	367'056.00	0.06 a)	
XS2153409029	1.9940 % TTEFP 1.994 04/08/32 EMTN	300	100	0	400 EUR	86.22%	344'872.00	0.06 a)	
XS2153459123	2.0000 % LUC5HI 2 04/06/29 EMTN	150	0	0	150 EUR	89.86%	134'793.00	0.02 a)	
XS2154325489	3.3750 % SYNNVX 3 3/8 04/16/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.01%	285'027.00	0.05 a)	
XS2154347293	1.5000 % OMVAV 1 1/2 04/09/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.67%	195'348.00	0.03 a)	
XS2154347707	2.0000 % OMVAV 2 04/09/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.69%	185'374.00	0.03 a)	
XS2154348424	2.3750 % OMVAV 2 3/8 04/09/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.50%	265'500.00	0.05 a)	
XS2154418144	1.1250 % RDSALN 1 1/8 04/07/24 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.31%	243'275.00	0.04 a)	
XS2154418730	1.5000 % RDSALN 1 1/2 04/07/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	90.04%	90'042.00	0.02 a)	
XS2154419118	1.8750 % RDSALN 1 7/8 04/07/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	84.39%	253'170.00	0.04 a)	
XS2155365641	3.5000 % LPTY 3 1/2 04/09/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.75%	197'492.00	0.03 a)	
XS2156581394	2.0000 % REPSM 2 12/15/25	200	0	0	200 EUR	95.64%	191'276.00	0.03 a)	
XS2156583259	2.6250 % REPSM 2 5/8 04/15/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.83%	187'652.00	0.03 a)	
XS2156598281	1.6250 % AKZANA 1 5/8 04/14/30 EMTN	250	100	250	100 EUR	85.73%	85'728.00	0.01 a)	
XS2156607702	0.6250 % ENBW 0 5/8 04/17/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.87%	187'730.00	0.03 a)	
XS2156787090	1.2500 % SSELN 1 1/4 04/16/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	94.71%	189'426.00	0.03 a)	
XS2156787173	1.7500 % SSELN 1 3/4 04/16/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	86.45%	216'120.00	0.04 a)	
XS2159791990	1.9500 % HNDA 1.95 10/18/24	200	0	0	200 EUR	97.06%	194'124.00	0.03 a)	
XS2162004209	0.5000 % ONTTFT 0 1/2 05/06/25	500	0	0	500 EUR	93.15%	465'770.00	0.08 a)	
XS2163320679	0.7500 % SWFP 0 3/4 04/27/25	200	0	0	200 EUR	94.27%	188'530.00	0.03 a)	
XS2163333656	1.0000 % SWFP 1 04/27/29	300	0	0	300 EUR	86.86%	260'568.00	0.04 a)	
XS2166122304	0.5000 % APD 0 1/2 05/05/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.82%	169'638.00	0.03 a)	
XS2166312939	0.4500 % OMERFT 0.45 05/13/25 REGS	250	0	0	250 EUR	93.04%	232'595.00	0.04 a)	
XS2166619663	1.3750 % FIRMEN 1 3/8 10/30/26	200	0	0	200 EUR	91.86%	183'726.00	0.03 a)	
XS2166619820	1.7500 % FIRMEN 1 3/4 04/30/30	200	0	0	200 EUR	86.59%	173'184.00	0.03 a)	
XS2166754957	1.3750 % SLB 1 3/8 10/28/26	280	0	280	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2166755509	2.0000 % SLB 2 05/06/32	200	150	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2167002521	0.7500 % SWEDA 0 3/4 05/05/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.28%	279'849.00	0.05 a)	
XS2167003685	1.2500 % C 1 1/4 07/06/26 EMTN	300	300	0	600 EUR	93.45%	560'670.00	0.10 a)	
XS2167007249	1.3380 % WFC 1.338 05/04/25 EMTN	0	800	0	800 EUR	96.84%	774'752.00	0.13 a)	
XS2167007918	1.7410 % WFC 1.741 05/04/30 EMTN	0	900	250	650 EUR	85.76%	557'453.00	0.10 a)	
XS2168285000	0.8750 % RABOBK 0 7/8 05/05/28 GMTN	200	100	0	300 EUR	86.88%	260'625.00	0.04 a)	
XS2168307333	0.7500 % APH 0 3/4 05/04/26	150	0	0	150 EUR	91.85%	137'773.50	0.02 a)	
XS2168478068	1.2500 % CRHID 1 1/4 11/05/26 EMTN	0	150	0	150 EUR	91.72%	137'586.00	0.02 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
X52168625460	0.2500 % PEP 0 1/4 05/06/24	150	100	0	250 EUR	96.14%	240'337.50	0.04	a)
X52168625544	0.5000 % PEP 0 1/2 05/06/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	85.34%	256'017.00	0.04	a)
X52168629967	1.2500 % HEIANA 1 1/4 05/07/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.55%	157'102.00	0.03	a)
X52168630205	1.7500 % HEIANA 1 3/4 05/07/40 EMTN	250	0	0	250 EUR	72.28%	180'707.50	0.03	a)
X52168647357	1.3750 % SANTAN 1 3/8 01/05/26 EMTN	300	200	0	500 EUR	92.54%	462'715.00	0.08	a)
X52169281487	1.6250 % CRHID 1 5/8 05/05/30	250	0	0	250 EUR	85.89%	214'717.50	0.04	a)
X52170362672	0.1250 % NESNVX 0 1/8 11/12/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.10%	174'196.00	0.03	a)
X52170362912	0.3750 % NESNVX 0 3/8 05/12/32	250	0	0	250 EUR	75.82%	189'537.50	0.03	a)
X52170384130	0.5000 % RDSALN 0 1/2 05/11/24 EMTN	0	300	0	300 EUR	96.36%	289'092.00	0.05	a)
X52170386853	1.2500 % RDSALN 1 1/4 11/11/32 EMTN	150	0	0	150 EUR	78.58%	117'862.50	0.02	a)
X52170736180	0.7500 % CFRVX 0 3/4 05/26/28	0	200	0	200 EUR	88.19%	176'370.00	0.03	a)
X52170736263	1.1250 % CFRVX 1 1/8 05/26/32	0	300	0	300 EUR	81.71%	245'124.00	0.04	a)
X52171210862	0.3750 % HESLAN 0 3/8 05/12/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.26%	276'786.00	0.05	a)
X52171253912	0.5000 % OPBANK 0 1/2 08/12/25 EMTN	150	0	0	150 EUR	92.34%	138'505.50	0.02	a)
X52171316859	0.6250 % DANBNK 0 5/8 05/26/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	92.92%	232'307.50	0.04	a)
X52171713006	1.1130 % EUROGR 1.113 05/15/32 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52171874519	0.5000 % NDASS 0 1/2 05/14/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	87.79%	263'364.00	0.05	a)
X52171875839	2.7500 % CPIPEGR 2 3/4 05/12/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.18%	162'364.00	0.03	a)
X52175848170	1.6250 % VLVY 1 5/8 05/26/25 EMTN	150	0	0	150 EUR	95.26%	142'888.50	0.02	a)
X52176534795	0.7500 % WURTH 0 3/4 11/22/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.67%	175'332.00	0.03	a)
X52176558620	1.5000 % BERTEL 1 1/2 05/15/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.69%	171'384.00	0.03	a)
X52176562812	2.3750 % WPPLN 2 3/8 05/19/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.87%	187'740.00	0.03	a)
X52176569312	1.6180 % TTEFP 1.618 05/18/40 EMTN	300	0	0	300 EUR	68.85%	206'541.00	0.04	a)
X52176605306	0.9520 % TTEFP 0.952 05/18/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.43%	160'868.00	0.03	a)
X52176621170	2.1250 % INTNED 2 1/8 05/26/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	90.88%	272'625.00	0.05	a)
X52176686546	0.4500 % CS 0.45 05/19/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	90.04%	90'040.00	0.02	a)
X52176715667	0.3750 % SAPGR 0 3/8 05/18/29	200	0	0	200 EUR	83.49%	166'976.00	0.03	a)
X52176783319	1.2500 % ENIIM 1 1/4 05/18/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52176785447	2.0000 % ENIIM 2 05/18/31 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52177013252	0.3750 % RKTLLN 0 3/8 05/19/26 REGS	200	0	0	200 EUR	90.50%	181'000.00	0.03	a)
X52177013765	0.7500 % RKTLLN 0 3/4 05/19/30 REGS	200	100	0	300 EUR	82.09%	246'279.00	0.04	a)
X52177122541	0.3750 % DPWGR 0 3/8 05/20/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	91.69%	183'388.00	0.03	a)
X52177122624	0.7500 % DPWGR 0 3/4 05/20/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	86.58%	86'579.00	0.01	a)
X52177122897	1.0000 % DPWGR 1 05/20/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	81.50%	244'506.00	0.04	a)
X52177441990	1.2010 % TELEFO 1.201 08/21/27 EMTN	200	100	0	300 EUR	90.03%	270'096.00	0.05	a)
X52177442295	1.8070 % TELEFO 1.807 05/21/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	83.38%	250'143.00	0.04	a)
X52178585423	2.1250 % CONGR 2 1/8 11/27/23 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52178586157	2.5000 % CONGR 2 1/2 08/27/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52178769076	1.0000 % FMEGR 1 05/29/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	90.93%	181'866.00	0.03	a)
X52178769159	1.5000 % FMEGR 1 1/2 05/29/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.74%	157'476.00	0.03	a)
X52178832379	3.3750 % STLA 3 3/8 07/07/23	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52178833427	0.7500 % EQNR 0 3/4 05/22/26 EMTN	0	250	0	250 EUR	91.16%	227'900.00	0.04	a)
X52178833690	1.3750 % EQNR 1 3/8 05/22/32 EMTN	0	350	0	350 EUR	81.76%	286'170.50	0.05	a)
X52178833773	3.8750 % STLA 3 7/8 01/05/26	250	0	0	250 EUR	99.93%	249'835.00	0.04	a)
X52178957077	1.8750 % REDEXS 1 7/8 05/28/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.20%	190'406.00	0.03	a)
X52179037697	2.1250 % ISPIM 2 1/8 05/26/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	95.60%	239'000.00	0.04	a)
X52179959817	1.8750 % VVOYHT 1 7/8 05/27/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	85.96%	214'892.50	0.04	a)
X52180007549	1.6000 % T 1.6 05/19/28	300	150	0	450 EUR	88.58%	398'601.00	0.07	a)
X52180008513	2.0500 % T 2.05 05/19/32	350	0	0	350 EUR	83.56%	292'467.00	0.05	a)
X52180009081	2.6000 % T 2.6 05/19/38	150	0	0	150 EUR	78.70%	118'056.00	0.02	a)
X52181959110	2.7140 % SRENVX 2.714 06/04/52 EMTN	200	0	0	200 EUR	79.75%	159'500.00	0.03	a)
X52182054887	0.3750 % SIEGR 0 3/8 06/05/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.27%	180'546.00	0.03	a)
X52182055181	0.2500 % SIEGR 0 1/4 06/05/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.77%	287'319.00	0.05	a)
X52182404298	0.7500 % BBVASM 0 3/4 06/04/25 GMTN	0	600	300	300 EUR	93.58%	280'731.00	0.05	a)
X52183818637	2.5000 % STANLN 2 1/2 09/09/30	300	0	0	300 EUR	93.67%	281'013.00	0.05	a)
X52185867673	1.6250 % OPBANK 1 5/8 06/09/30	200	0	0	200 EUR	91.75%	183'500.00	0.03	a)
X52185997884	3.7500 % REPSM 3 3/4 PERP	0	200	0	200 EUR	92.88%	185'750.00	0.03	a)
X52186001314	4.2470 % REPSM 4.247 PERP	0	200	0	200 EUR	89.50%	179'000.00	0.03	a)
X52187689034	3.5000 % VW 3 1/2 PERP	400	0	0	400 EUR	93.25%	373'000.00	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2187689380	3.8750 % VW 3 7/8 PERP	300	0	0	300 EUR	85.38%	256'125.00	0.04	a)
XS2188805688	0.8750 % COVEGR 0 7/8 02/03/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	92.03%	138'037.50	0.02	a)
XS2188805845	1.3750 % COVEGR 1 3/8 06/12/30 EMTN	0	150	0	150 EUR	82.51%	123'769.50	0.02	a)
XS2189594315	2.1250 % SIGCBL 2 1/8 06/18/25 REGS	200	0	0	200 EUR	94.36%	188'726.00	0.03	a)
XS2189613982	0.7500 % OMNAV 0 3/4 06/16/30 EMTN	150	0	0	150 EUR	81.41%	122'115.00	0.02	a)
XS2189786226	2.8750 % RBAV 2 7/8 06/18/32	100	0	0	100 EUR	81.88%	81'875.00	0.01	a)
XS2189931335	0.5500 % MET 0.55 06/16/27 GMTN	150	0	0	150 EUR	87.86%	131'787.00	0.02	a)
XS2189970317	1.8750 % ZURNVX 1 7/8 09/17/50 EMTN	100	0	0	100 EUR	80.45%	80'454.00	0.01	a)
XS2190134184	1.2500 % UCGIM 1 1/4 06/16/26 EMTN	450	0	0	450 EUR	93.20%	419'413.50	0.07	a)
XS2190256706	0.7500 % SRGIM 0 3/4 06/17/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.27%	156'548.00	0.03	a)
XS2191362859	1.2500 % DLR 1 1/4 02/01/31	100	100	0	200 EUR	76.18%	152'352.00	0.03	a)
XS2191509038	0.3750 % CARLB 0 3/8 06/30/27	0	100	0	100 EUR	86.35%	86'353.00	0.01	a)
XS2192431380	0.2500 % IGIM 0 1/4 06/24/25 EMTN	0	150	0	150 EUR	91.97%	137'952.00	0.02	a)
XS2193657561	1.1250 % CONGR 1 1/8 09/25/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2193661324	3.2500 % BPLN 3 1/4 PERP	600	100	0	700 EUR	92.63%	648'375.00	0.11	a)
XS2193662728	3.6250 % BPLN 3 5/8 PERP	550	100	0	650 EUR	87.88%	571'187.50	0.10	a)
XS2193669657	1.1250 % AMCR 1 1/8 06/23/27	150	0	0	150 EUR	87.94%	131'908.50	0.02	a)
XS2193733503	1.0000 % CZGRID 1 07/16/27	200	0	0	200 EUR	84.78%	169'560.00	0.03	a)
XS2193734733	1.6250 % DELL 1 5/8 06/24/24	200	0	0	200 EUR	96.40%	192'796.00	0.03	a)
XS2193956716	0.3750 % HYN0E 0 3/8 06/25/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.24%	190'482.00	0.03	a)
XS2193978363	0.2500 % DSM 0 1/4 06/23/28	150	0	0	150 EUR	84.05%	126'067.50	0.02	a)
XS2193979254	0.6250 % DSM 0 5/8 06/23/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	76.70%	153'400.00	0.03	a)
XS2193982803	1.3620 % VTRS 1.362 06/23/27	0	600	0	600 EUR	87.09%	522'552.00	0.09	a)
XS2193983108	1.9080 % VTRS 1.908 06/23/32	0	400	0	400 EUR	76.42%	305'676.00	0.05	a)
XS2194192527	2.0000 % IFXGR 2 06/24/32 EMTN	200	100	100	200 EUR	84.56%	169'112.00	0.03	a)
XS2194283672	1.1250 % IFXGR 1 1/8 06/24/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	91.71%	275'130.00	0.05	a)
XS2194283839	1.6250 % IFXGR 1 5/8 06/24/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.82%	175'632.00	0.03	a)
XS2194370727	1.1250 % SANTAN 1 1/8 06/23/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.51%	177'024.00	0.03	a)
XS2195092601	2.2500 % ABESM 2 1/4 03/29/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.50%	176'998.00	0.03	a)
XS2196328608	1.8750 % ENBW 1 7/8 06/29/2080	200	0	0	200 EUR	88.50%	177'000.00	0.03	a)
XS2197076651	2.7500 % HELNSW 2 3/4 09/30/41	200	0	0	200 EUR	80.00%	159'992.00	0.03	a)
XS2197342129	0.1250 % OPBANK 0 1/8 07/01/24 EMTN	350	0	0	350 EUR	95.33%	333'637.50	0.06	a)
XS2197348324	0.7500 % TACHEM 0 3/4 07/09/27	117	450	317	250 EUR	87.62%	219'052.50	0.04	a)
XS2197348597	1.0000 % TACHEM 1 07/09/29	233	250	233	250 EUR	83.32%	208'292.50	0.04	a)
XS2197349645	1.3750 % TACHEM 1 3/8 07/09/32	334	300	334	300 EUR	78.75%	236'262.00	0.04	a)
XS2197356186	1.0000 % IREIM 1 07/01/30 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2197673747	3.0000 % MTXGR 3 07/01/25	150	0	0	150 EUR	97.98%	146'976.00	0.03	a)
XS2197675288	1.8640 % TELEFO 1.864 07/13/40 EMTN	200	0	0	200 EUR	70.18%	140'354.00	0.02	a)
XS2197770279	1.7500 % BRTFOD 1 3/4 07/22/25	250	0	0	250 EUR	89.78%	224'437.50	0.04	a)
XS2198580271	0.7500 % WKLNA 0 3/4 07/03/30	250	0	0	250 EUR	80.74%	201'857.50	0.03	a)
XS2198582301	2.0000 % TACHEM 2 07/09/40	274	274	274	274 EUR	70.82%	194'044.06	0.03	a)
XS2199265617	0.3750 % BAYNGR 0 3/8 07/06/24	300	0	0	300 EUR	95.35%	286'038.00	0.05	a)
XS2199266003	0.7500 % BAYNGR 0 3/4 01/06/27	400	0	0	400 EUR	88.24%	352'940.00	0.06	a)
XS2199266268	1.1250 % BAYNGR 1 1/8 01/06/30	300	0	0	300 EUR	82.24%	246'711.00	0.04	a)
XS2199266698	1.3750 % BAYNGR 1 3/8 07/06/32	400	0	0	400 EUR	78.16%	312'636.00	0.05	a)
XS2199351375	4.5000 % STLA 4 1/2 07/07/28	500	0	0	500 EUR	101.84%	509'180.00	0.09	a)
XS2199604096	1.3750 % UQA 1 3/8 07/09/30	200	0	0	200 EUR	80.95%	161'896.00	0.03	a)
XS2200150766	0.7500 % CABKSM 0 3/4 07/10/26 EMTN	500	0	0	500 EUR	92.01%	460'025.00	0.08	a)
XS2200175839	1.5000 % LOGICR 1 1/2 07/13/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	86.42%	129'633.00	0.02	a)
XS2200513070	0.8230 % NGGLN 0.823 07/07/32 EMTN	0	300	0	300 EUR	74.56%	223'692.00	0.04	a)
XS2202744384	2.2500 % CEPSE 2 1/4 02/13/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.18%	188'356.00	0.03	a)
XS2202902636	1.7500 % DEVOBA 1 3/4 10/22/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	90.88%	90'875.00	0.02	a)
XS2203802462	3.3750 % NEPSJ 3 3/8 07/14/27	150	0	0	150 EUR	89.55%	134'317.50	0.02	a)
XS2203996132	1.0000 % SWFP 1 07/17/28	150	0	0	150 EUR	88.63%	132'951.00	0.02	a)
XS2206379567	2.2500 % AMCOSP 2 1/4 07/17/27 GMTN	250	0	0	250 EUR	89.62%	224'050.00	0.04	a)
XS2206380573	1.5000 % AMCOSP 1 1/2 07/17/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2207430120	2.3740 % TENN 2.374 PERP	300	0	0	300 EUR	93.88%	281'625.00	0.05	a)
XS2207976783	2.2000 % UCGIM 2.2 07/22/27 EMTN	350	0	0	350 EUR	91.36%	319'767.00	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2209023402	0.7500 % TRNIM 0 3/4 07/24/32	250	0	0	250 EUR	75.88%	189'702.50	0.03	a)
XS2218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/2080	0	100	0	100 EUR	88.38%	88'375.00	0.02	a)
XS2221845683	1.2500 % MUNRE 1 1/4 05/26/41	200	0	0	200 EUR	76.13%	152'250.00	0.03	a)
XS2224439385	2.5000 % OMVAV 2 1/2 PERP	200	0	0	200 EUR	90.13%	180'250.00	0.03	a)
XS2224439971	2.8750 % OMVAV 2 7/8 PERP	200	0	0	200 EUR	83.75%	167'500.00	0.03	a)
XS2224621420	0.6250 % ADSGR 0 5/8 09/10/35	200	0	0	200 EUR	69.86%	139'718.00	0.02	a)
XS2224632971	2.0000 % TTEFP 2 PERP	250	0	0	250 EUR	76.88%	192'187.50	0.03	a)
XS2225207468	1.3750 % HEIBOS 1 3/8 03/03/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	82.63%	206'577.50	0.04	a)
XS2225890537	1.1250 % ATH 1 1/8 09/02/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.25%	182'506.00	0.03	a)
XS2225893630	1.5000 % DANBNK 1 1/2 09/02/30 EMTN	150	0	0	150 EUR	90.63%	135'937.50	0.02	a)
XS2226645278	2.5000 % SAMPFH 2 1/2 09/03/52 EMTN	300	300	300	300 EUR	77.13%	231'375.00	0.04	a)
XS2227050023	0.3750 % LUCSHI 0 3/8 09/08/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.64%	171'286.00	0.03	a)
XS2227050379	0.8750 % LUCSHI 0 7/8 09/08/32 EMTN	250	0	0	250 EUR	75.19%	187'962.50	0.03	a)
XS2227196404	1.0000 % BACRED 1 09/08/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.21%	176'418.00	0.03	a)
XS2227905903	0.5000 % AMT 0 1/2 01/15/28	500	0	0	500 EUR	82.94%	414'705.00	0.07	a)
XS2227906208	1.0000 % AMT 1 01/15/32	0	100	0	100 EUR	73.86%	73'857.00	0.01	a)
XS2228245838	1.1250 % SABSMT 1 1/8 03/11/27	200	0	0	200 EUR	90.63%	181'250.00	0.03	a)
XS2228260043	2.8750 % RYAIT 2 7/8 09/15/25 EMTN	270	170	270	170 EUR	97.12%	165'107.40	0.03	a)
XS2228683277	2.6520 % NSANY 2.652 03/17/26 REGS	200	0	0	200 EUR	93.80%	187'594.00	0.03	a)
XS2228683350	3.2010 % NSANY 3.201 09/17/28 REGS	250	0	0	250 EUR	89.18%	222'945.00	0.04	a)
XS2228892860	1.1250 % GLENLN 1 1/8 03/10/28 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2228897158	1.0000 % AKFAST 1 01/17/28 EMTN	150	0	0	150 EUR	80.84%	121'263.00	0.02	a)
XS2230399441	2.8750 % AIB 2 7/8 05/30/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.73%	181'456.00	0.03	a)
XS2230884657	0.1250 % VLVY 0 1/8 09/17/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.37%	188'736.00	0.03	a)
XS2231165668	1.5000 % BEVLUX 1 1/2 09/16/27	200	0	0	200 EUR	87.82%	175'630.00	0.03	a)
XS2231183646	1.6250 % HITTFP 1 5/8 09/18/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	84.32%	252'948.00	0.04	a)
XS2231267829	0.6250 % YBS 0 5/8 09/21/25	0	150	0	150 EUR	91.31%	136'968.00	0.02	a)
XS2231330965	0.3750 % JCI 0 3/8 09/15/27	0	200	0	200 EUR	85.15%	170'308.00	0.03	a)
XS2231331344	1.0000 % JCI 1 09/15/32	200	0	0	200 EUR	78.12%	156'236.00	0.03	a)
XS2231792586	0.5000 % FCABNK 0 1/2 09/18/23 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2232115423	1.0000 % DLR 1 01/15/32	400	0	0	400 EUR	72.44%	289'776.00	0.05	a)
XS2233154538	0.1250 % KO 0 1/8 03/15/29	200	0	0	200 EUR	80.93%	161'852.00	0.03	a)
XS2233155261	0.3750 % KO 0 3/8 03/15/33	0	150	0	150 EUR	71.87%	107'800.50	0.02	a)
XS2233155345	0.8000 % KO 0.8 03/15/40	0	150	0	150 EUR	61.92%	92'875.50	0.02	a)
XS2234567233	0.8750 % VW 0 7/8 09/22/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	83.19%	249'558.00	0.04	a)
XS2234567662	1.2500 % VW 1 1/4 09/23/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	76.26%	76'262.00	0.01	a)
XS2235986929	0.0000 % MDLZ 0 09/22/26 REGS	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2235987224	0.3750 % MDLZ 0 3/8 09/22/29 REGS	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2236363573	1.8750 % AMSSM 1 7/8 09/24/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	90.27%	361'060.00	0.06	a)
XS2237447961	1.1250 % FREGR 1 1/8 01/28/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	71.27%	71'266.00	0.01	a)
XS2237901355	0.3750 % TRNIM 0 3/8 09/25/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	77.59%	155'184.00	0.03	a)
XS2238783422	2.3750 % JAPTOB 2 3/8 04/07/2081	0	400	200	200 EUR	90.50%	181'000.00	0.03	a)
XS2238783778	2.8750 % JAPTOB 2 7/8 10/07/2083	0	100	0	100 EUR	85.88%	85'875.00	0.01	a)
XS2238787415	0.0000 % MDT 0 10/15/25	200	0	0	200 EUR	91.03%	182'062.00	0.03	a)
XS2238789460	0.3750 % MDT 0 3/8 10/15/28	200	0	0	200 EUR	83.11%	166'210.00	0.03	a)
XS2238792175	0.7500 % MDT 0 3/4 10/15/32	200	100	0	300 EUR	76.12%	228'363.00	0.04	a)
XS2238792332	1.3750 % MDT 1 3/8 10/15/40	400	0	0	400 EUR	65.21%	260'844.00	0.04	a)
XS2238792688	1.6250 % MDT 1 5/8 10/15/50	200	0	0	200 EUR	57.76%	115'518.00	0.02	a)
XS2240063730	0.1250 % DGELN 0 1/8 09/28/28 EMTN	0	150	0	150 EUR	83.04%	124'564.50	0.02	a)
XS2240133459	0.0000 % MDT 0 03/15/23	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2240494471	1.6250 % IHGLN 1 5/8 10/08/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.03%	192'056.00	0.03	a)
XS2240505268	0.0000 % ADSGR 0 10/05/28	0	200	0	200 EUR	82.63%	165'260.00	0.03	a)
XS2240507801	2.1250 % INFLN 2 1/8 10/06/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.01%	190'018.00	0.03	a)
XS2241387096	0.6930 % MIZUHO 0.693 10/07/30 EMTN	0	750	750	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2241387252	0.2140 % MIZUHO 0.214 10/07/25 EMTN	0	400	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2241825111	1.3750 % GSWITC 1 3/8 10/07/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	81.58%	203'957.50	0.04	a)
XS2242633258	0.4000 % PEP 0.4 10/09/32	200	100	0	300 EUR	74.39%	223'155.00	0.04	a)
XS2242633332	1.0500 % PEP 1.05 10/09/50	200	0	0	200 EUR	59.13%	118'262.00	0.02	a)
XS2242728041	0.2500 % ENBW 0 1/4 10/19/30	200	0	0	200 EUR	75.75%	151'500.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2242747181	0.1550 % ASABRE 0.155 10/23/24	200	0	0	200 EUR	93.88%	187'756.00	0.03	a)
XS2242747348	0.5410 % ASABRE 0.541 10/23/28	250	0	0	250 EUR	82.80%	207'010.00	0.04	a)
XS2242921711	0.5000 % RTOLN 0 1/2 10/14/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	82.11%	164'218.00	0.03	a)
XS2242929532	2.6250 % ENIIM 2 5/8 PERP NC5	350	100	450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2242931603	3.3750 % ENIIM 3 3/8 PERP NC9	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2242979719	1.5000 % HTHROW 1 1/2 10/12/25	250	0	0	250 EUR	93.24%	233'087.50	0.04	a)
XS2243299463	0.8750 % LUNDC 0 7/8 10/14/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.17%	172'334.00	0.03	a)
XS2243564478	2.5000 % IIAAV 2 1/2 10/15/27	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2244415175	1.6010 % DAAFIN 1.601 11/05/32	200	0	0	200 EUR	78.45%	156'896.00	0.03	a)
XS2244941063	1.8740 % IBESM 1.874 PERP NC5	400	0	0	400 EUR	89.38%	357'500.00	0.06	a)
XS2244941147	2.2500 % IBESM 2 1/4 PERP NC8	300	0	0	300 EUR	82.00%	246'000.00	0.04	a)
XS2247936342	1.6250 % SANTAN 1 5/8 10/22/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	79.13%	237'396.00	0.04	a)
XS2248451978	0.6540 % BAC 0.654 10/26/31 EMTN	600	0	0	600 EUR	76.48%	458'874.00	0.08	a)
XS2250008245	0.4950 % MS 0.495 10/26/29	0	500	0	500 EUR	80.82%	404'120.00	0.07	a)
XS2250376477	0.6250 % AEMSPA 0 5/8 10/28/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	71.38%	71'382.00	0.01	a)
XS2251233651	1.1250 % AKFAST 1 1/8 01/11/29 EMTN	150	250	100	300 EUR	77.84%	233'517.00	0.04	a)
XS2251626896	0.3750 % ENGSM 0 3/8 11/05/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	74.05%	74'045.00	0.01	a)
XS2251736646	0.3090 % HSBC 0.309 11/13/26 GEN	200	0	0	200 EUR	89.83%	179'664.00	0.03	a)
XS2251736992	0.7700 % HSBC 0.77 11/13/31	250	0	0	250 EUR	76.83%	192'085.00	0.03	a)
XS2257961818	0.1250 % UPMFH 0 1/8 11/19/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	81.43%	203'562.50	0.04	a)
XS2258389415	0.1000 % OPBANK 0.1 11/16/27 EMTN	350	0	0	350 EUR	84.25%	294'885.50	0.05	a)
XS2258452478	0.2500 % INTNED 0 1/4 02/18/29	400	0	0	400 EUR	81.13%	324'500.00	0.06	a)
XS2258558464	0.1250 % FCABNK 0 1/8 11/16/23 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2258971071	0.3750 % CABKSM 0 3/8 11/18/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.20%	267'612.00	0.05	a)
XS2259210677	0.0500 % ONTTFT 0.05 11/25/30 GMTN	300	0	0	300 EUR	75.59%	226'761.00	0.04	a)
XS2262065159	0.1250 % TENN 0 1/8 11/30/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	71.50%	142'994.00	0.02	a)
XS2262065233	0.5000 % TENN 0 1/2 11/30/40 EMTN	100	0	0	100 EUR	58.66%	58'658.00	0.01	a)
XS2263684776	0.0000 % NESNVX 0 03/03/33 EMTN	150	0	0	150 EUR	70.49%	105'732.00	0.02	a)
XS2263684933	0.3750 % NESNVX 0 3/8 12/03/40	200	0	0	200 EUR	58.17%	116'330.00	0.02	a)
XS2264074647	2.3750 % LOUDRE 2 3/8 11/27/25	250	0	0	250 EUR	94.62%	236'542.50	0.04	a)
XS2264161964	0.1250 % TELIAS 0 1/8 11/27/30	150	0	0	150 EUR	75.72%	113'580.00	0.02	a)
XS2264193819	0.8720 % NGGLN 0.872 11/26/40 EMTN	200	0	0	200 EUR	57.04%	114'078.00	0.02	a)
XS2264977146	0.2000 % CCEP 0.2 12/02/28	250	0	0	250 EUR	81.04%	202'590.00	0.03	a)
XS2265360359	0.6250 % STERV 0 5/8 12/02/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.82%	157'642.00	0.03	a)
XS2265371042	0.3500 % MQGAU 0.35 03/03/28	0	350	0	350 EUR	82.02%	287'063.00	0.05	a)
XS2265990452	0.2500 % HERIM 0 1/4 12/03/30 EMTN	250	250	150	350 EUR	74.89%	262'104.50	0.05	a)
XS2267889991	2.0000 % ATOSTR 2 12/04/28	0	330	0	330 EUR	84.66%	279'374.70	0.05	a)
XS2268340010	0.0000 % SRGIM 0 12/07/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	79.14%	158'276.00	0.03	a)
XS2270147924	0.9330 % BPLN 0.933 12/04/40 EMTN	150	0	0	150 EUR	57.69%	86'539.50	0.01	a)
XS2270150399	0.0500 % VW 0.05 06/10/24	200	0	0	200 EUR	95.25%	190'508.00	0.03	a)
XS2278566299	2.0000 % ATOSTR 2 01/15/30	0	300	0	300 EUR	81.47%	244'419.00	0.04	a)
XS2280835260	0.6250 % DLR 0 5/8 07/15/31	200	0	0	200 EUR	71.04%	142'080.00	0.02	a)
XS2280845145	0.2000 % BMW 0.2 01/11/33 EMTN	0	150	0	150 EUR	72.45%	108'679.50	0.02	a)
XS2280845491	0.0000 % BMW 0 01/11/26 EMTN	0	250	0	250 EUR	90.79%	226'975.00	0.04	a)
XS2281155254	0.2500 % INTNED 0 1/4 02/01/30	300	0	0	300 EUR	77.75%	233'250.00	0.04	a)
XS2281342878	0.0500 % BAYNGR 0.05 01/12/25	400	0	0	400 EUR	93.08%	372'320.00	0.06	a)
XS2281343256	0.3750 % BAYNGR 0 3/8 01/12/29	200	0	0	200 EUR	80.86%	161'724.00	0.03	a)
XS2281343413	0.6250 % BAYNGR 0 5/8 07/12/31	300	0	0	300 EUR	75.33%	226'002.00	0.04	a)
XS2281343686	1.0000 % BAYNGR 1 01/12/36	300	0	0	300 EUR	67.51%	202'521.00	0.03	a)
XS2281473111	0.0000 % HEMSOF 0 01/19/28 EMTN	150	0	0	150 EUR	80.25%	120'372.00	0.02	a)
XS2282093769	0.0000 % VW 0 07/12/23 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2282094494	0.2500 % VW 0 1/4 01/12/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.43%	178'860.00	0.03	a)
XS2282095970	0.5000 % VW 0 1/2 01/12/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	79.77%	159'532.00	0.03	a)
XS2282195176	0.6250 % ATH 0 5/8 01/12/28 GMTN	200	0	0	200 EUR	81.12%	162'238.00	0.03	a)
XS2282210231	0.2000 % SWEDA 0.2 01/12/28 GMTN	300	500	0	800 EUR	82.10%	656'824.00	0.11	a)
XS2286012849	0.8750 % LOGICR 0 7/8 01/14/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	67.86%	135'710.00	0.02	a)
XS2286044024	0.5000 % CBREGI 0 1/2 01/27/28	150	0	0	150 EUR	77.34%	116'002.50	0.02	a)
XS2286044370	0.0000 % ABBNVX 0 01/19/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	78.36%	235'089.00	0.04	a)
XS2286442186	0.6250 % HOLNSW 0 5/8 01/19/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	69.39%	138'778.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2287624584	0.1250 % MOTOPG 0 1/8 07/20/28 EMTN	150	0	0	150 EUR	82.63%	123'939.00	0.02	a)
XS2288948859	0.1000 % EOANGR 0.1 12/19/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	81.37%	162'732.00	0.03	a)
XS2289133758	0.8500 % UCGIM 0.85 01/19/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	74.13%	222'387.00	0.04	a)
XS2289133915	0.3250 % UCGIM 0.325 01/19/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.84%	269'517.00	0.05	a)
XS2289408440	0.1630 % NGGLN 0.163 01/20/28 EMTN	300	200	0	500 EUR	82.91%	414'560.00	0.07	a)
XS2289797248	0.9050 % NATUEN 0.905 01/22/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	76.62%	76'624.00	0.01	a)
XS2289877941	0.3750 % TSCOLN 0 3/8 07/27/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	78.04%	234'123.00	0.04	a)
XS2290544068	1.5000 % CPIPGR 1 1/2 01/27/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	58.82%	117'636.00	0.02	a)
XS2290960520	1.6250 % TTEFP 1 5/8 PERP NC7	300	0	0	300 EUR	82.50%	247'500.00	0.04	a)
XS2290960876	2.1250 % TTEFP 2 1/8 PERP NC12	500	0	0	500 EUR	72.88%	364'375.00	0.06	a)
XS2292263121	0.4970 % MS 0.497 02/07/31	0	600	0	600 EUR	76.72%	460'308.00	0.08	a)
XS2292487076	0.2500 % ACEIM 0 1/4 07/28/30 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2292547317	0.5790 % FIREIT 0.579 01/29/31 EMTN	0	150	0	150 EUR	75.59%	113'388.00	0.02	a)
XS2292954893	0.2500 % GS 0 1/4 01/26/28 EMTN	480	0	0	480 EUR	82.90%	397'905.60	0.07	a)
XS2295333988	1.8250 % IBESM 1.825 PERP NC9	300	0	0	300 EUR	78.00%	234'000.00	0.04	a)
XS2295335413	1.4500 % IBESM 1.45 PERP NC6	300	0	0	300 EUR	85.88%	257'625.00	0.04	a)
XS2296204444	0.5000 % PLD 0 1/2 02/16/32	300	0	0	300 EUR	72.13%	216'378.00	0.04	a)
XS2296206068	1.0000 % PLD 1 02/16/41	200	100	0	300 EUR	57.71%	173'127.00	0.03	a)
XS2297177664	0.2500 % ESSITY 0 1/4 02/08/31	300	0	0	300 EUR	74.25%	222'753.00	0.04	a)
XS2297190097	0.0000 % TEL 0 02/16/29	0	200	0	200 EUR	79.73%	159'466.00	0.03	a)
XS2297549391	0.5000 % CABKSM 0 1/2 02/09/29 EMTN	400	0	0	400 EUR	81.79%	327'140.00	0.06	a)
XS2297882644	0.1250 % VATFAL 0 1/8 02/12/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.41%	162'822.00	0.03	a)
XS2298304499	0.2000 % SANTAN 0.2 02/11/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	82.44%	247'305.00	0.04	a)
XS2298459426	1.2130 % BDX 1.213 02/12/36	250	0	0	250 EUR	69.62%	174'057.50	0.03	a)
XS2299001888	0.0000 % IGIM 0 02/16/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	82.69%	82'686.00	0.01	a)
XS2299002423	0.5000 % IGIM 0 1/2 02/16/33 EMTN	250	0	0	250 EUR	70.41%	176'035.00	0.03	a)
XS2299135819	1.0000 % DANBNK 1 05/15/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.75%	175'500.00	0.03	a)
XS2301127119	0.7500 % AKFAST 0 3/4 02/22/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	72.34%	144'674.00	0.02	a)
XS2303052695	0.7500 % CTPNV 0 3/4 02/18/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.76%	161'510.00	0.03	a)
XS2303070911	0.2500 % HMBSS 0 1/4 08/25/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	77.41%	154'810.00	0.03	a)
XS2304340263	0.2500 % EQIX 0 1/4 03/15/27	150	0	0	150 EUR	85.97%	128'961.00	0.02	a)
XS2304340693	1.0000 % EQIX 1 03/15/33	200	0	0	200 EUR	75.20%	150'396.00	0.03	a)
XS2304664167	0.6250 % ISPIM 0 5/8 02/24/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	89.49%	223'722.50	0.04	a)
XS2304664597	1.3500 % ISPIM 1.35 02/24/31 EMTN	250	0	0	250 EUR	74.64%	186'595.00	0.03	a)
XS2305026929	0.3420 % NTT 0.342 03/03/30 REGS	0	350	0	350 EUR	79.00%	276'510.50	0.05	a)
XS2305244241	0.2500 % LPTY 0 1/4 02/23/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	89.20%	222'987.50	0.04	a)
XS2305600723	0.0000 % SANSFC 0 02/23/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.61%	177'212.00	0.03	a)
XS2306082293	0.9500 % WPC 0.95 06/01/30	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2306220190	0.0000 % ALDFP 0 02/23/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.02%	192'042.00	0.03	a)
XS2306517876	0.2500 % DNBNO 0 1/4 02/23/29 EMTN	0	400	0	400 EUR	82.63%	330'500.00	0.06	a)
XS2306601746	1.8750 % EZJLN 1 7/8 03/03/28 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2306851853	0.6250 % RABOBK 0 5/8 02/25/33 GMTN	200	300	0	500 EUR	71.98%	359'910.00	0.06	a)
XS2306988564	0.5000 % ENBW 0 1/2 03/01/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	70.99%	70'985.00	0.01	a)
XS2307764238	0.7500 % GLENLN 0 3/4 03/01/29 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2307764311	1.2500 % GLENLN 1 1/4 03/01/33 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2307853098	0.7800 % NWG 0.78 02/26/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	79.94%	239'826.00	0.04	a)
XS2307863642	0.1250 % KO 0 1/8 03/09/29	300	0	0	300 EUR	81.07%	243'204.00	0.04	a)
XS2307863998	0.5000 % KO 0 1/2 03/09/33	250	0	0	250 EUR	73.07%	182'675.00	0.03	a)
XS2307864020	1.0000 % KO 1 03/09/41	350	0	0	350 EUR	63.41%	221'921.00	0.04	a)
XS2308298962	0.3750 % DEVOBA 0 3/8 03/03/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.85%	163'694.00	0.03	a)
XS2308616841	0.5000 % DSVDC 0 1/2 03/03/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	76.81%	153'616.00	0.03	a)
XS2310118976	1.2500 % CABKSM 1 1/4 06/18/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	87.25%	261'750.00	0.05	a)
XS2310747915	0.1280 % ETN 0.128 03/08/26	100	150	0	250 EUR	89.12%	222'797.50	0.04	a)
XS2310748483	0.5770 % ETN 0.577 03/08/30	250	0	0	250 EUR	80.43%	201'072.50	0.03	a)
XS2310797696	1.1250 % SPG 1 1/8 03/19/33	200	100	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2311407352	0.3750 % BKIR 0 3/8 05/10/27 EMTN	150	0	0	150 EUR	87.63%	131'437.50	0.02	a)
XS2311412865	0.3750 % MUBAUH 0 3/8 03/10/27 GMTN	0	200	0	200 EUR	87.95%	175'896.00	0.03	a)
XS2311413160	1.0000 % MUBAUH 1 03/10/34 GMTN	200	0	0	200 EUR	74.32%	148'634.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2312723138	0.7500 % MDLZ 0 3/4 03/17/33	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2312744217	1.3750 % ENELIM 1 3/8 PERP 65Y	400	0	0	400 EUR	81.00%	324'000.00	0.06 a)	
XS2312746345	1.8750 % ENELIM 1 7/8 PERP 95Y	300	0	0	300 EUR	72.00%	216'000.00	0.04 a)	
XS2314246526	1.5000 % STEDIN 1 1/2 PERP	100	0	0	100 EUR	84.50%	84'500.00	0.01 a)	
XS2314312179	1.3750 % AXASA 1 3/8 10/07/41 EMTN	200	0	0	200 EUR	76.13%	152'250.00	0.03 a)	
XS2314657409	0.7500 % PRIFII 0 3/4 03/23/33 EMTN	300	0	0	300 EUR	68.17%	204'504.00	0.04 a)	
XS2315784806	1.2500 % APAAU 1 1/4 03/15/33 EMTN	0	250	0	250 EUR	73.21%	183'032.50	0.03 a)	
XS2317069685	0.7500 % ISPIM 0 3/4 03/16/28 EMTN	200	100	0	300 EUR	83.54%	250'623.00	0.04 a)	
XS2317288301	0.3750 % ADNA 0 3/8 03/18/30	250	0	0	250 EUR	79.60%	198'987.50	0.03 a)	
XS2319954710	1.2000 % STANLIN 1.2 09/23/31 EMTN	250	0	0	250 EUR	85.73%	214'317.50	0.04 a)	
XS2320438653	0.6250 % CDTFIN 0 5/8 03/19/30 EMTN	150	0	0	150 EUR	77.71%	116'562.00	0.02 a)	
XS2320453884	0.5000 % UPMFH 0 1/2 03/22/31 EMTN	0	150	0	150 EUR	76.69%	115'038.00	0.02 a)	
XS2320533131	2.5000 % REPSM 2 1/2 PERP	0	200	0	200 EUR	86.13%	172'250.00	0.03 a)	
XS2320745156	1.3750 % HANRUE 1 3/8 06/30/42	0	400	0	400 EUR	73.25%	293'000.00	0.05 a)	
XS2320746394	0.9000 % VERAU 0.9 04/01/41	200	0	0	200 EUR	65.08%	130'158.00	0.02 a)	
XS2320747285	0.2500 % OPBANK 0 1/4 03/24/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.99%	177'988.00	0.03 a)	
XS2320789014	0.1250 % HYNOC 0 1/8 06/30/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.20%	174'402.00	0.03 a)	
XS2321427408	0.6940 % BAC 0.694 03/22/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.22%	156'444.00	0.03 a)	
XS2321466133	1.1250 % BACR 1 1/8 03/22/31 EMTN	250	0	0	250 EUR	86.70%	216'740.00	0.04 a)	
XS2321526480	0.5000 % NDASS 0 1/2 03/19/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	78.11%	78'112.00	0.01 a)	
XS2322254249	1.0000 % GS 1 03/18/33 EMTN	400	0	0	400 EUR	72.46%	289'832.00	0.05 a)	
XS2322289385	0.1250 % BBVASM 0 1/8 03/24/27 GMTN	300	300	300	300 EUR	88.38%	265'125.00	0.05 a)	
XS2322438990	0.8750 % CZGRID 0 7/8 03/31/31	150	0	0	150 EUR	72.07%	108'100.50	0.02 a)	
XS2324321285	0.5000 % SANTAN 0 1/2 03/24/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.61%	265'839.00	0.05 a)	
XS2325562424	0.0000 % FREGR 0 10/01/25	0	200	0	200 EUR	90.04%	180'082.00	0.03 a)	
XS2325562697	0.8750 % FREGR 0 7/8 10/01/31 EMTN	150	0	0	150 EUR	72.28%	108'423.00	0.02 a)	
XS2325565104	0.5000 % FREGR 0 1/2 10/01/28 EMTN	150	0	0	150 EUR	80.40%	120'592.50	0.02 a)	
XS2326546350	0.5000 % UBS 0 1/2 03/31/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	76.70%	230'106.00	0.04 a)	
XS2326546434	0.0100 % UBS 0.01 03/31/26 EMTN	500	0	0	500 EUR	88.55%	442'765.00	0.08 a)	
XS2327299884	0.7500 % LSELN 0 3/4 04/06/33	200	0	0	200 EUR	75.08%	150'162.00	0.03 a)	
XS2327420977	0.6000 % EOANGR 0.6 10/01/32 EMTN	0	400	0	400 EUR	74.04%	296'140.00	0.05 a)	
XS2328823104	1.1250 % HTHROW 1 1/8 10/08/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.31%	156'618.00	0.03 a)	
XS2328980979	0.0100 % ASABRE 0.01 04/19/24	0	200	0	200 EUR	95.56%	191'126.00	0.03 a)	
XS2328981431	0.3360 % ASABRE 0.336 04/19/27	150	0	0	150 EUR	86.41%	129'610.50	0.02 a)	
XS2329144591	0.8430 % MIZUHO 0.843 04/12/33 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2331216577	0.1250 % SCBNOR 0 1/8 04/14/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.83%	175'656.00	0.03 a)	
XS2331315635	0.3750 % ENEXIS 0 3/8 04/14/33 EMTN	350	0	0	350 EUR	72.24%	252'822.50	0.04 a)	
XS2332179725	0.0500 % LANSBK 0.05 04/15/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.65%	175'308.00	0.03 a)	
XS2332234413	0.1250 % SGSNVX 0 1/8 04/21/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	85.92%	257'763.00	0.04 a)	
XS2332254015	0.0000 % FCABNK 0 04/16/24 EMTN	0	250	0	250 EUR	95.37%	238'420.00	0.04 a)	
XS2332552541	1.6250 % LOUDRE 1 5/8 04/28/28	200	0	0	200 EUR	86.19%	172'384.00	0.03 a)	
XS2332689681	0.3750 % DNFSDC 0 3/8 10/28/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	81.41%	203'525.00	0.04 a)	
XS2332689764	0.7500 % DNFSDC 0 3/4 04/28/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	75.62%	151'242.00	0.03 a)	
XS2332980932	0.7500 % AMCOSP 0 3/4 04/20/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.23%	162'458.00	0.03 a)	
XS2333297625	0.7410 % EUROGR 0.741 04/21/33 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2333391485	0.7500 % LUCSHI 0 3/4 04/22/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	73.14%	146'278.00	0.03 a)	
XS2334852253	2.0000 % ENIIM 2 PERP NC6	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2334857138	2.7500 % ENIIM 2 3/4 PERP NC9	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2337060607	0.0000 % CCEP 0 09/06/25	150	0	0	150 EUR	91.04%	136'552.50	0.02 a)	
XS2337061670	0.5000 % CCEP 0 1/2 09/06/29	100	0	0	100 EUR	81.33%	81'333.00	0.01 a)	
XS2337061753	0.8750 % CCEP 0 7/8 05/06/33	300	0	0	300 EUR	74.18%	222'543.00	0.04 a)	
XS2337061837	1.5000 % CCEP 1 1/2 05/06/41	250	0	0	250 EUR	67.18%	167'947.50	0.03 a)	
XS2337252931	0.4500 % FDX 0.45 05/04/29	0	200	0	200 EUR	79.74%	159'474.00	0.03 a)	
XS2337253319	0.9500 % FDX 0.95 05/04/33	0	150	0	150 EUR	72.05%	108'070.50	0.02 a)	
XS2337285519	0.5000 % FEMSA 0 1/2 05/28/28	250	0	0	250 EUR	83.29%	208'220.00	0.04 a)	
XS2337285865	1.0000 % FEMSA 1 05/28/33	150	0	0	150 EUR	72.65%	108'969.00	0.02 a)	
XS2337326727	1.7500 % ADRIT 1 3/4 07/30/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	79.42%	158'836.00	0.03 a)	
XS2338355105	0.0100 % GS 0.01 04/30/24 EMTN	549	0	549	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2338643740	0.4060 % MS 0.406 10/29/27	0	600	0	600 EUR	86.82%	520'890.00	0.09	a)
XS2339398971	0.4000 % KO 0.4 05/06/30	300	0	0	300 EUR	79.48%	238'428.00	0.04	a)
XS2339399359	0.9500 % KO 0.95 05/06/36	100	0	0	100 EUR	70.15%	70'146.00	0.01	a)
XS2341269970	1.1250 % AKERBP 1 1/8 05/12/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	82.04%	164'084.00	0.03	a)
XS2342060360	1.1060 % BACR 1.106 05/12/32	400	0	0	400 EUR	74.70%	298'788.00	0.05	a)
XS2342206591	0.7660 % WSTP 0.766 05/13/31	300	0	0	300 EUR	86.06%	258'192.00	0.04	a)
XS2342706996	0.0000 % VLVY 0 05/18/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	88.50%	132'745.50	0.02	a)
XS2342732562	3.7480 % VW 3.748 PERP	0	300	0	300 EUR	87.38%	262'125.00	0.05	a)
XS2342732646	4.3750 % VW 4 3/8 PERP	0	400	0	400 EUR	83.88%	335'500.00	0.06	a)
XS2343114687	0.8750 % ERFFP 0 7/8 05/19/31	0	150	0	150 EUR	74.65%	111'975.00	0.02	a)
XS2343340852	0.5000 % AIB 0 1/2 11/17/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.33%	172'658.00	0.03	a)
XS2343459074	0.6250 % NDASS 0 5/8 08/18/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	87.00%	261'000.00	0.04	a)
XS2343540519	0.5000 % REESM 0 1/2 05/24/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	75.17%	150'348.00	0.03	a)
XS2343563214	0.3000 % SWEDA 0.3 05/20/27	350	0	0	350 EUR	87.63%	306'687.50	0.05	a)
XS2343821794	0.0000 % VW 0 07/19/24 EMTN	350	0	0	350 EUR	94.61%	331'149.00	0.06	a)
XS2343822503	0.6250 % VW 0 5/8 07/19/29 EMTN	0	150	0	150 EUR	78.64%	117'957.00	0.02	a)
XS2343822842	0.3750 % VW 0 3/8 07/20/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	87.88%	263'625.00	0.05	a)
XS2343846940	1.0000 % BWA 1 05/19/31	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2343850033	0.9500 % MQGAU 0.95 05/21/31 EMTN	0	250	0	250 EUR	75.97%	189'930.00	0.03	a)
XS2344384768	0.1000 % ONTTFT 0.1 05/19/28 EMTN	200	100	0	300 EUR	83.35%	250'062.00	0.04	a)
XS2344384842	0.9000 % ONTTFT 0.9 05/20/41 EMTN	350	0	0	350 EUR	63.05%	220'664.50	0.04	a)
XS2344385815	0.8750 % RYRID 0 7/8 05/25/26 EMTN	200	350	200	350 EUR	90.24%	315'826.00	0.05	a)
XS2344569038	0.8750 % SEGPLP 0 7/8 05/27/29	150	0	0	150 EUR	78.01%	117'013.50	0.02	a)
XS2344735811	0.3750 % ENIIM 0 3/8 06/14/28 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2344772426	1.7500 % HMSOLN 1 3/4 06/03/27	250	0	0	250 EUR	82.27%	205'675.00	0.04	a)
XS2345035963	1.2500 % WAB 1 1/4 12/03/27	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2345798271	1.1020 % BAC 1.102 05/24/32 EMTN	500	0	0	500 EUR	77.95%	389'770.00	0.07	a)
XS2345799089	0.5830 % BAC 0.583 08/24/28 EMTN	150	200	0	350 EUR	84.84%	296'933.00	0.05	a)
XS2345982362	0.2500 % CS 0 1/4 01/05/26 EMTN	300	400	300	400 EUR	86.29%	345'172.00	0.06	a)
XS2345996743	1.0000 % ERICB 1 05/26/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	77.22%	154'438.00	0.03	a)
XS2346124410	0.3750 % HESLAN 0 3/8 06/04/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	79.11%	237'339.00	0.04	a)
XS2346206902	0.4500 % AMT 0.45 01/15/27	300	0	0	300 EUR	86.04%	258'129.00	0.04	a)
XS2346207892	0.8750 % AMT 0 7/8 05/21/29	0	150	0	150 EUR	80.23%	120'343.50	0.02	a)
XS2346208197	1.2500 % AMT 1 1/4 05/21/33	300	0	0	300 EUR	73.69%	221'055.00	0.04	a)
XS2346225878	0.5000 % MET 0 1/2 05/25/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	82.09%	246'276.00	0.04	a)
XS2346253730	0.7500 % CABKSM 0 3/4 05/26/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	85.29%	255'876.00	0.04	a)
XS2346973741	1.5000 % CIMAU 1 1/2 05/28/29 GMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2347284742	1.1250 % TEFP 1 1/8 05/28/28	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2347663507	0.3750 % AZN 0 3/8 06/03/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	82.02%	164'036.00	0.03	a)
XS2348030268	0.0000 % NOVOB 0 06/04/24 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.45%	190'898.00	0.03	a)
XS2348030425	0.1250 % NOVOB 0 1/8 06/04/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	84.29%	210'717.50	0.04	a)
XS2348325221	0.1250 % TENN 0 1/8 12/09/27 EMTN	150	100	0	250 EUR	85.74%	214'337.50	0.04	a)
XS2348325494	0.5000 % TENN 0 1/2 06/09/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.17%	156'340.00	0.03	a)
XS2348325650	1.1250 % TENN 1 1/8 06/09/41 EMTN	250	0	0	250 EUR	65.63%	164'075.00	0.03	a)
XS2348408514	1.0000 % SPPDIS 1 06/09/31	150	0	0	150 EUR	65.05%	97'575.00	0.02	a)
XS2348638433	1.0000 % ABNANV 1 06/02/33	300	0	0	300 EUR	73.95%	221'856.00	0.04	a)
XS2348703864	1.0000 % BEVLUX 1 01/16/30	200	0	0	200 EUR	76.55%	153'092.00	0.03	a)
XS2350621863	0.0000 % NESNVX 0 06/14/26 EMTN	500	0	0	500 EUR	89.29%	446'455.00	0.08	a)
XS2350632472	0.2500 % NESNVX 0 1/4 06/14/29 EMTN	150	0	0	150 EUR	82.93%	124'392.00	0.02	a)
XS2350744434	0.8750 % NESNVX 0 7/8 06/14/41 EMTN	200	0	0	200 EUR	64.04%	128'086.00	0.02	a)
XS2350746215	0.6250 % NESNVX 0 5/8 02/14/34 EMTN	0	150	0	150 EUR	73.80%	110'698.50	0.02	a)
XS2350756446	0.8750 % INTNED 0 7/8 06/09/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	84.63%	84'625.00	0.01	a)
XS2351032227	0.8750 % WORAU 0 7/8 06/09/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.51%	175'020.00	0.03	a)
XS2351220814	0.7500 % DANBNK 0 3/4 06/09/29 EMTN	0	150	0	150 EUR	82.00%	123'000.00	0.02	a)
XS2351301499	0.7500 % AXACOR 0 3/4 06/14/28	200	0	0	200 EUR	78.42%	156'832.00	0.03	a)
XS2353182020	0.0000 % ENELIM 0 06/17/27 EMTN	0	400	0	400 EUR	84.17%	336'684.00	0.06	a)
XS2353182293	0.5000 % ENELIM 0 1/2 06/17/30 EMTN	400	0	0	400 EUR	76.55%	306'188.00	0.05	a)
XS2353182376	0.8750 % ENELIM 0 7/8 06/17/36 EMTN	300	100	0	400 EUR	63.29%	253'164.00	0.04	a)
XS2353473692	1.3750 % RBAIV 1 3/8 06/17/33	200	0	0	200 EUR	72.25%	144'500.00	0.02	a)
XS2354246816	0.3750 % OPBANK 0 3/8 06/16/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.73%	81'729.00	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2354444023	0.0000 % JDEPNA 0 01/16/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	88.56%	177'116.00	0.03	a)
XS2354444379	1.1250 % JDEPNA 1 1/8 06/16/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	72.73%	145'454.00	0.03	a)
XS2354569407	0.5000 % JDEPNA 0 1/2 01/16/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	80.01%	160'022.00	0.03	a)
XS2355599197	0.1250 % NWG 0 1/8 06/18/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	87.64%	262'917.00	0.05	a)
XS2356029541	0.5000 % CTPNV 0 1/2 06/21/25 EMTN	0	150	0	150 EUR	89.24%	133'852.50	0.02	a)
XS2356030556	1.2500 % CTPNV 1 1/4 06/21/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	74.49%	148'974.00	0.03	a)
XS2356040357	0.7500 % STLA 0 3/4 01/18/29 EMTN	500	0	0	500 EUR	82.01%	410'045.00	0.07	a)
XS2356041165	1.2500 % STLA 1 1/4 06/20/33 EMTN	200	150	0	350 EUR	72.17%	252'584.50	0.04	a)
XS2356049069	0.3750 % SEB 0 3/8 06/21/28 GMTN	300	0	0	300 EUR	82.12%	246'372.00	0.04	a)
XS2356091269	0.2500 % DEVOBA 0 1/4 06/22/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.57%	175'138.00	0.03	a)
XS2356311139	0.8800 % AIA 0.88 09/09/33 GMTN	0	200	0	200 EUR	79.63%	159'250.00	0.03	a)
XS2356569736	1.0000 % BYLAN 1 09/23/31	200	0	0	200 EUR	84.13%	168'250.00	0.03	a)
XS2357205587	0.3750 % TRNIM 0 3/8 06/23/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.12%	162'236.00	0.03	a)
XS2357417257	0.6250 % SANTAN 0 5/8 06/24/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	82.13%	246'375.00	0.04	a)
XS2357754097	1.7130 % ASSGEN 1.713 06/30/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	75.97%	75'972.00	0.01	a)
XS2358231798	0.6250 % SRGIM 0 5/8 06/30/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	75.42%	150'840.00	0.03	a)
XS2358471246	0.5000 % YBS 0 1/2 07/01/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	81.98%	204'955.00	0.04	a)
XS2358736051	0.4190 % CHGRID 0.419 09/08/28	300	0	0	300 EUR	79.54%	238'617.00	0.04	a)
XS2360310044	0.8000 % UCGIM 0.8 07/05/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	82.17%	246'516.00	0.04	a)
XS2360881549	0.7500 % DSVDC 0 3/4 07/05/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	71.65%	143'308.00	0.02	a)
XS2361358299	0.3750 % REPSM 0 3/8 07/06/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.50%	160'994.00	0.03	a)
XS2361358539	0.8750 % REPSM 0 7/8 07/06/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	72.86%	145'718.00	0.03	a)
XS2362968906	0.1000 % WSTPNZ 0.1 07/13/27	100	150	0	250 EUR	83.37%	208'420.00	0.04	a)
XS2363117321	0.3000 % HNDA 0.3 07/07/28	250	150	0	400 EUR	82.62%	330'460.00	0.06	a)
XS2364001078	0.6250 % AEMSPA 0 5/8 07/15/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	74.49%	148'988.00	0.03	a)
XS2369906644	0.9000 % NDAQ 0.9 07/30/33	0	350	0	350 EUR	71.34%	249'704.00	0.04	a)
XS2373642102	0.5770 % BACR 0.577 08/09/29	500	0	0	500 EUR	79.71%	398'550.00	0.07	a)
XS2374594823	0.3750 % VW 0 3/8 02/12/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	75.85%	189'627.50	0.03	a)
XS2374595044	0.1250 % VW 0 1/8 02/12/27 EMTN	350	0	0	350 EUR	85.36%	298'753.00	0.05	a)
XS2374595127	0.0000 % VW 0 02/12/25 EMTN	150	0	0	150 EUR	92.73%	139'095.00	0.02	a)
XS2375844144	0.3340 % BDX 0.334 08/13/28	200	0	0	200 EUR	82.59%	165'176.00	0.03	a)
XS2375844656	1.3360 % BDX 1.336 08/13/41	300	0	0	300 EUR	60.72%	182'154.00	0.03	a)
XS2381261424	1.0000 % MUNRE 1 05/26/42	300	0	0	300 EUR	71.63%	214'875.00	0.04	a)
XS2381277008	2.1250 % ENBW 2 1/8 08/31/2081	200	0	0	200 EUR	70.88%	141'750.00	0.02	a)
XS2381362966	0.2500 % BNS 0 1/4 11/01/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	80.64%	201'592.50	0.03	a)
XS2381560411	0.2500 % ASBBNK 0 1/4 09/08/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	80.30%	240'912.00	0.04	a)
XS2381599898	0.0500 % RBAV 0.05 09/01/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.55%	161'096.00	0.03	a)
XS2381671671	0.2500 % CS 0 1/4 09/01/28 EMTN	250	1'100	350	1'000 EUR	74.00%	740'040.00	0.13	a)
XS2381853279	0.2500 % NGGLN 0 1/4 09/01/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	81.35%	325'392.00	0.06	a)
XS2381853436	0.7500 % NGGLN 0 3/4 09/01/33 EMTN	400	0	0	400 EUR	69.79%	279'144.00	0.05	a)
XS2382950330	1.0430 % NWG 1.043 09/14/32 EMTN	0	150	0	150 EUR	81.53%	122'292.00	0.02	a)
XS2383886947	0.0000 % LXSGR 0 09/08/27 EMTN	150	0	0	150 EUR	85.08%	127'612.50	0.02	a)
XS2383901761	0.4700 % MIZUHO 0.47 09/06/29	0	400	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2384269101	0.2500 % LPTY 0 1/4 09/07/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	87.45%	262'362.00	0.05	a)
XS2384269366	0.7500 % HEIBOS 0 3/4 09/06/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	69.54%	173'857.50	0.03	a)
XS2384274366	0.6500 % GM 0.65 09/07/28	400	0	0	400 EUR	80.73%	322'936.00	0.06	a)
XS2384274440	0.3750 % WOWAU 0 3/8 11/15/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	79.48%	158'960.00	0.03	a)
XS2384413311	0.3660 % ATH 0.366 09/10/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.38%	170'754.00	0.03	a)
XS2384473992	0.3750 % OPBANK 0 3/8 12/08/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	80.31%	240'936.00	0.04	a)
XS2384697830	0.5000 % PSA 0 1/2 09/09/30	250	250	250	250 EUR	75.46%	188'637.50	0.03	a)
XS2384715244	0.4500 % DXC 0.45 09/15/27 REGS	250	0	0	250 EUR	82.91%	207'282.50	0.04	a)
XS2384716721	0.9500 % DXC 0.95 09/15/31 REGS	200	0	0	200 EUR	75.40%	150'802.00	0.03	a)
XS2384723263	0.2500 % MDLZ 0 1/4 09/09/29 REGS	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2384726282	0.6250 % MDLZ 0 5/8 09/09/32 REGS	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2384726449	1.2500 % MDLZ 1 1/4 09/09/41 REGS	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2385390724	0.6250 % SAUR 0 5/8 09/16/28	200	0	0	200 EUR	80.45%	160'900.00	0.03	a)
XS2385397901	0.0000 % CMCSA 0 09/14/26	207	150	0	357 EUR	87.79%	313'399.59	0.05	a)
XS2385398206	0.2500 % CMCSA 0 1/4 09/14/29	201	0	0	201 EUR	79.66%	160'114.59	0.03	a)
XS2385790667	0.2500 % NWDIE 0 1/4 09/14/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.75%	161'508.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2385791046	0.6030 % SANUK 0.603 09/13/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	79.88%	239'625.00	0.04	a)
XS2386186063	0.5000 % LLY 0 1/2 09/14/33	200	100	0	300 EUR	73.97%	221'901.00	0.04	a)
XS2386186576	1.1250 % LLY 1 1/8 09/14/51	150	100	0	250 EUR	54.59%	136'480.00	0.02	a)
XS2386220698	1.3750 % LLY 1 3/8 09/14/61	200	0	0	200 EUR	49.60%	99'196.00	0.02	a)
XS2386592484	0.1250 % ADENVX 0 1/8 09/21/28 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2386592567	0.5000 % ADENVX 0 1/2 09/21/31 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2387052744	0.8750 % CASTSS 0 7/8 09/17/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	71.43%	178'567.50	0.03	a)
XS2387060259	0.6700 % NWG 0.67 09/14/29	300	0	0	300 EUR	80.66%	241'980.00	0.04	a)
XS2387735470	0.8750 % DSVDC 0 7/8 09/17/36 EMTN	0	150	0	150 EUR	66.26%	99'394.50	0.02	a)
XS2388182573	0.5000 % SKGID 0 1/2 09/22/29	100	0	0	100 EUR	79.38%	79'376.00	0.01	a)
XS2388183381	1.0000 % SKGID 1 09/22/33	200	0	0	200 EUR	72.61%	145'220.00	0.03	a)
XS2388449758	0.5000 % NNGRNV 0 1/2 09/21/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.96%	81'962.00	0.01	a)
XS2388491289	0.6410 % HSBC 0.641 09/24/29	200	0	0	200 EUR	81.25%	162'500.00	0.03	a)
XS2388557998	1.4670 % BPLN 1.467 09/21/41	300	0	0	300 EUR	62.38%	187'140.00	0.03	a)
XS2389343380	0.5000 % ABNAV 0 1/2 09/23/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	79.20%	237'606.00	0.04	a)
XS2389353264	0.7500 % GS 0 3/4 03/23/32 EMTN	400	0	0	400 EUR	73.08%	292'300.00	0.05	a)
XS2389688875	1.0000 % VITRRA 1 09/24/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	80.61%	201'515.00	0.03	a)
XS2389757944	0.2000 % ANZNZ 0.2 09/23/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	83.91%	251'718.00	0.04	a)
XS2390400633	0.0000 % ENELIM 0 05/28/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.11%	176'228.00	0.03	a)
XS2390400716	0.3750 % ENELIM 0 3/8 05/28/29 EMTN	0	250	0	250 EUR	79.52%	198'795.00	0.03	a)
XS2390400807	0.8750 % ENELIM 0 7/8 09/28/34 EMTN	500	0	0	500 EUR	67.07%	335'325.00	0.06	a)
XS2390506546	0.3750 % INTNED 0 3/8 09/29/28	300	200	0	500 EUR	83.00%	415'000.00	0.07	a)
XS2390530330	0.6250 % CTPNV 0 5/8 09/27/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	82.63%	123'943.50	0.02	a)
XS2390546849	1.5000 % CTPNV 1 1/2 09/27/31 EMTN	100	100	0	200 EUR	70.28%	140'566.00	0.02	a)
XS2391430837	0.8750 % AUSGF 0 7/8 10/07/31 EMTN	150	0	0	150 EUR	76.12%	114'172.50	0.02	a)
XS2393080077	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/04/28 GMTN	200	0	0	200 EUR	82.58%	165'168.00	0.03	a)
XS2393236000	0.2500 % MCD 0 1/4 10/04/28 GMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2393236695	0.8750 % MCD 0 7/8 10/04/33 GMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2393701953	0.9500 % AMT 0.95 10/05/30	200	0	0	200 EUR	77.03%	154'064.00	0.03	a)
XS2394063437	0.5000 % BNRGR 0 1/2 10/06/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.80%	157'592.00	0.03	a)
XS2397239000	0.2500 % HEIBOS 0 1/4 10/13/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.38%	180'752.00	0.03	a)
XS2397252011	1.6250 % HEIBOS 1 5/8 10/13/31 EMTN	250	0	0	250 EUR	67.91%	169'762.50	0.03	a)
XS2397252102	1.0000 % HEIBOS 1 04/13/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	77.04%	77'042.00	0.01	a)
XS2397357463	0.9000 % CBREGI 0.9 10/12/29	200	0	0	200 EUR	72.38%	144'768.00	0.02	a)
XS2397367421	0.7500 % PEP 0 3/4 10/14/33	300	0	0	300 EUR	75.09%	225'264.00	0.04	a)
XS2398710546	0.7500 % VESTNL 0 3/4 10/18/31 EMTN	150	0	0	150 EUR	74.47%	111'706.50	0.02	a)
XS2398807383	0.5000 % FINBAN 0 1/2 10/21/27	200	0	0	200 EUR	86.15%	172'306.00	0.03	a)
XS2399154181	0.9540 % WESAU 0.954 10/21/33 EMTN	250	250	250	250 EUR	73.25%	183'122.50	0.03	a)
XS2399933386	1.0000 % HERIM 1 04/25/34 EMTN	150	0	0	150 EUR	72.05%	108'072.00	0.02	a)
XS2400296773	0.7500 % FNMIM 0 3/4 10/20/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	86.75%	216'865.00	0.04	a)
XS2400445289	0.5000 % DELL 0 1/2 10/27/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	87.15%	130'725.00	0.02	a)
XS2401704189	1.2500 % AXACOR 1 1/4 04/26/30	200	0	0	200 EUR	73.82%	147'636.00	0.03	a)
XS2402178300	0.7500 % CKHH 0 3/4 11/02/29	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2402178565	1.0000 % CKHH 1 11/02/33	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2403444677	0.5000 % NDASS 0 1/2 11/02/28 EMTN	350	0	0	350 EUR	81.87%	286'559.00	0.05	a)
XS2403519601	1.7500 % BCRED 1 3/4 11/30/26 REGS	200	0	0	200 EUR	84.51%	169'028.00	0.03	a)
XS2403533263	1.0000 % AEMSPA 1 11/02/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	71.63%	143'266.00	0.02	a)
XS2404027935	0.2500 % SWEDA 0 1/4 11/02/26 GMTN	0	350	0	350 EUR	87.73%	307'048.00	0.05	a)
XS2404028230	1.1020 % MS 1.102 04/29/33 GMTN	0	400	0	400 EUR	74.70%	298'788.00	0.05	a)
XS2404213485	0.3500 % PG 0.35 05/05/30	0	100	0	100 EUR	80.59%	80'589.00	0.01	a)
XS2404214020	0.9000 % PG 0.9 11/04/41	160	0	0	160 EUR	64.57%	103'315.20	0.02	a)
XS2404642923	0.8750 % GS 0 7/8 05/09/29 EMTN	274	0	0	274 EUR	81.13%	222'307.16	0.04	a)
XS2404651163	1.0000 % SANTAN 1 11/04/31 EMTN	400	0	0	400 EUR	77.63%	310'504.00	0.05	a)
XS2405390043	0.5000 % SYDBDC 0 1/2 11/10/26	0	200	0	200 EUR	89.25%	178'500.00	0.03	a)
XS2405467528	0.1250 % GIS 0 1/8 11/15/25	0	200	0	200 EUR	90.75%	181'490.00	0.03	a)
XS2405855375	1.5750 % IBESM 1.575 PERP	0	200	0	200 EUR	83.13%	166'250.00	0.03	a)
XS2405875480	0.3000 % CL 0.3 11/10/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	82.78%	165'556.00	0.03	a)
XS2406549464	0.0100 % DANBNK 0.01 11/10/24 EMTN	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2406569579	0.8750 % TENN 0 7/8 06/16/35 EMTN	350	0	0	350 EUR	72.64%	254'247.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2406890066	0.8750 % KPN 0 7/8 11/15/33 GMTN	400	0	0	400 EUR	72.98%	291'900.00	0.05	a)
XS2406913884	0.0000 % OTIS 0 11/12/23	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2406914346	0.3180 % OTIS 0.318 12/15/26	300	0	0	300 EUR	86.53%	259'587.00	0.04	a)
XS2406915236	0.9340 % OTIS 0.934 12/15/31	200	0	0	200 EUR	77.03%	154'056.00	0.03	a)
XS2407010656	0.6250 % JDEPNA 0 5/8 02/09/28 EMTN	0	250	0	250 EUR	83.85%	209'632.50	0.04	a)
XS2407357768	0.1250 % NWVG 0 1/8 11/12/25 EMTN	350	0	0	350 EUR	89.74%	314'086.50	0.05	a)
XS2407529309	1.0000 % INTNED 1 11/16/32	300	0	0	300 EUR	82.25%	246'750.00	0.04	a)
XS2407955827	0.5000 % HENKEL 0 1/2 11/17/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	76.91%	153'818.00	0.03	a)
XS2407969885	0.8000 % STANLN 0.8 11/17/29	0	200	0	200 EUR	81.94%	163'886.00	0.03	a)
XS2407985220	0.0000 % STEDIN 0 11/16/26 EMTN	0	150	0	150 EUR	87.52%	131'281.50	0.02	a)
XS2410368042	0.7500 % MAERSK 0 3/4 11/25/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	76.24%	152'488.00	0.03	a)
XS2411135150	0.9500 % ONTFTT 0.95 11/24/51 EMTN	200	0	0	200 EUR	51.55%	103'108.00	0.02	a)
XS2411166973	0.8750 % NNGRNV 0 7/8 11/23/31 EMTN	250	0	0	250 EUR	76.88%	192'187.50	0.03	a)
XS2411241693	1.7500 % TALANX 1 3/4 12/01/42	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2411311579	0.0820 % NTT 0.082 12/13/25 EMTN	0	250	0	250 EUR	90.67%	226'670.00	0.04	a)
XS2411311652	0.3990 % NTT 0.399 12/13/28 EMTN	0	250	0	250 EUR	83.24%	208'092.50	0.04	a)
XS2411720233	0.3750 % SANDSS 0 3/8 11/25/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	82.70%	165'408.00	0.03	a)
XS2412267358	1.0000 % ATIM 1 11/25/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	87.63%	219'082.50	0.04	a)
XS2412267515	1.5000 % ATIM 1 1/2 01/25/30 EMTN	400	0	0	400 EUR	79.06%	316'236.00	0.05	a)
XS2412267788	2.3750 % ATIM 2 3/8 11/25/33 EMTN	300	0	0	300 EUR	75.60%	226'800.00	0.04	a)
XS2412556461	1.1250 % CRDEM 1 1/8 01/19/28	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2413696761	0.1250 % INTNED 0 1/8 11/29/25	300	100	100	300 EUR	92.88%	278'625.00	0.05	a)
XS2413697140	0.8750 % INTNED 0 7/8 11/29/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	78.75%	157'500.00	0.03	a)
XS2414830963	0.8750 % KYGID 0 7/8 12/01/31	0	200	0	200 EUR	78.71%	157'414.00	0.03	a)
XS2415386726	0.6250 % LXSGR 0 5/8 12/01/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.33%	156'662.00	0.03	a)
XS2416413339	0.3750 % RABOBK 0 3/8 12/01/27 GMTN	200	100	0	300 EUR	86.63%	259'875.00	0.04	a)
XS2421006201	0.4270 % WSTPNZ 0.427 12/14/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.98%	173'960.00	0.03	a)
XS2428716000	1.3750 % DLR 1 3/8 07/18/32	0	150	0	150 EUR	73.66%	110'496.00	0.02	a)
XS2430951660	0.8770 % BACR 0.877 01/28/28	0	200	0	200 EUR	86.35%	172'698.00	0.03	a)
XS2430970884	0.8320 % ATH 0.832 01/08/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	85.70%	171'400.00	0.03	a)
XS2430988893	0.8750 % BBVASM 0 7/8 01/14/29	0	600	300	300 EUR	84.13%	252'381.00	0.04	a)
XS2431029441	1.8750 % AXASA 1 7/8 07/10/42 EMTN	0	400	0	400 EUR	76.00%	304'000.00	0.05	a)
XS2431319107	2.0000 % LOGICR 2 01/17/34 EMTN	200	0	0	200 EUR	67.74%	135'476.00	0.02	a)
XS2431320378	1.0000 % BACRED 1 07/17/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	82.70%	165'408.00	0.03	a)
XS2432130610	2.0000 % TTEFP 2 PERP	0	200	0	200 EUR	86.50%	173'000.00	0.03	a)
XS2432131188	3.2500 % TTEFP 3 1/4 PERP	0	200	0	200 EUR	74.88%	149'750.00	0.03	a)
XS2432162654	1.7500 % CPIPGR 1 3/4 01/14/30 EMTN	0	250	0	250 EUR	64.55%	161'382.50	0.03	a)
XS2432293673	0.2500 % ENELIM 0 1/4 11/17/25	0	200	0	200 EUR	90.96%	181'922.00	0.03	a)
XS2432293756	0.8750 % ENELIM 0 7/8 01/17/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	77.30%	154'592.00	0.03	a)
XS2432293913	1.2500 % ENELIM 1 1/4 01/17/35 EMTN	250	0	0	250 EUR	69.63%	174'067.50	0.03	a)
XS2432502008	0.5000 % TD 0 1/2 01/18/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	87.25%	261'756.00	0.05	a)
XS2432530637	0.5000 % SANSCF 0 1/2 01/14/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.28%	174'562.00	0.03	a)
XS2432544349	1.0000 % ESBIRE 1 07/19/34 EMTN	0	200	0	200 EUR	73.61%	147'218.00	0.03	a)
XS2432567555	0.3750 % DNBNO 0 3/8 01/18/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	87.38%	174'750.00	0.03	a)
XS2433135543	1.4750 % HITTFP 1.475 01/18/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	79.99%	159'978.00	0.03	a)
XS2433139966	0.9250 % UCGIM 0.925 01/18/28 EMTN	0	350	0	350 EUR	86.95%	304'318.00	0.05	a)
XS2433141947	1.6250 % UCGIM 1 5/8 01/18/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	77.19%	154'380.00	0.03	a)
XS2433206740	0.9430 % MQGAU 0.943 01/19/29	0	150	0	150 EUR	81.82%	122'731.50	0.02	a)
XS2433211310	0.7500 % SRGIM 0 3/4 06/20/29 EMTN	0	250	0	250 EUR	81.14%	202'845.00	0.03	a)
XS2433226854	1.2500 % SRGIM 1 1/4 06/20/34 EMTN	150	0	0	150 EUR	73.18%	109'770.00	0.02	a)
XS2433244089	0.1250 % EOANGR 0 1/8 01/18/26 EMTN	0	400	0	400 EUR	90.53%	362'128.00	0.06	a)
XS2433244246	0.8750 % EOANGR 0 7/8 10/18/34 EMTN	0	300	0	300 EUR	71.24%	213'720.00	0.04	a)
XS2433361719	1.0000 % WIZZLN 1 01/19/26 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2434701616	1.6250 % ATOSTR 1 5/8 01/25/28 EMTN	0	140	0	140 EUR	85.24%	119'329.00	0.02	a)
XS2434702424	0.6250 % CABKSM 0 5/8 01/21/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	87.23%	174'450.00	0.03	a)
XS2434702853	2.2500 % ATOSTR 2 1/4 01/25/32 EMTN	0	150	0	150 EUR	79.08%	118'623.00	0.02	a)
XS2434710872	1.0540 % NGGLN 1.054 01/20/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	78.55%	157'108.00	0.03	a)
XS2434787235	1.2500 % ABNANV 1 1/4 01/20/34 EMTN	0	300	0	300 EUR	73.35%	220'050.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2435603571	0.6250 % HEIBOS 0 5/8 07/24/25 EMTN	0	150	0	150 EUR	86.75%	130'129.50	0.02	a)
XS2435611244	1.3750 % HEIBOS 1 3/8 07/24/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	76.87%	153'732.00	0.03	a)
XS2436160779	0.1000 % SANTAN 0.1 01/26/25 EMTN	0	400	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2436807866	0.8750 % PTHREE 0 7/8 01/26/26 EMTN	0	150	0	150 EUR	88.32%	132'477.00	0.02	a)
XS2436807940	1.6250 % PTHREE 1 5/8 01/26/29 EMTN	0	150	0	150 EUR	78.10%	117'148.50	0.02	a)
XS2436853035	0.6250 % OPBANK 0 5/8 07/27/27 EMTN	0	150	0	150 EUR	85.59%	128'377.50	0.02	a)
XS2437854487	2.3750 % TRNIM 2 3/8 PERP	0	250	0	250 EUR	83.50%	208'750.00	0.04	a)
XS2438026366	1.2500 % THAMES 1 1/4 01/31/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	76.24%	152'482.00	0.03	a)
XS2438026440	0.8750 % THAMES 0 7/8 01/31/28	0	200	0	200 EUR	85.04%	170'078.00	0.03	a)
XS2438615606	0.2500 % VW 0 1/4 01/31/25 EMTN	0	300	0	300 EUR	93.38%	280'143.00	0.05	a)
XS2438616240	0.8750 % VW 0 7/8 01/31/28 EMTN	0	250	0	250 EUR	84.46%	211'147.50	0.04	a)
XS2439004412	1.0000 % PLD 1 02/08/29 EMTN	0	150	0	150 EUR	82.83%	124'237.50	0.02	a)
XS2439004685	1.5000 % PLD 1 1/2 02/08/34	0	200	0	200 EUR	75.11%	150'226.00	0.03	a)
XS2440678915	0.6250 % VLVY 0 5/8 02/14/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.92%	93'919.00	0.02	a)
XS2440690456	0.7500 % ATCOA 0 3/4 02/08/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	78.48%	156'960.00	0.03	a)
XS2441244535	0.7500 % NOVOB 0 3/4 03/31/25 EMTN	0	150	0	150 EUR	94.24%	141'354.00	0.02	a)
XS2441247041	1.3750 % NOVOB 1 3/8 03/31/30 EMTN	0	150	0	150 EUR	87.34%	131'014.50	0.02	a)
XS2441296923	0.5000 % SCBNOR 0 1/2 08/11/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	91.19%	182'384.00	0.03	a)
XS2441552192	1.2500 % GS 1 1/4 02/07/29 EMTN	0	350	0	350 EUR	83.93%	293'755.00	0.05	a)
XS2441574089	1.1250 % ERICB 1 1/8 02/08/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	86.40%	172'802.00	0.03	a)
XS2442764747	0.8750 % IBM 0 7/8 02/09/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	81.77%	163'534.00	0.03	a)
XS2442765124	1.2500 % IBM 1 1/4 02/09/34 EMTN	0	300	0	300 EUR	75.65%	226'947.00	0.04	a)
XS2442768227	0.7500 % SEB 0 3/4 08/09/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	86.84%	173'678.00	0.03	a)
XS2443438051	1.3750 % DANBNK 1 3/8 02/17/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	91.13%	182'250.00	0.03	a)
XS2443485565	1.3000 % SWEDA 1.3 02/17/27 GMTN	0	200	0	200 EUR	88.90%	177'790.00	0.03	a)
XS2443749648	2.7500 % TELIAS 2 3/4 06/30/2083	0	200	0	200 EUR	88.38%	176'750.00	0.03	a)
XS2443893255	1.1250 % NDASS 1 1/8 02/16/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	90.12%	270'366.00	0.05	a)
XS2443920249	1.2500 % INTNED 1 1/4 02/16/27	0	500	0	500 EUR	91.25%	456'250.00	0.08	a)
XS2443920751	1.7500 % INTNED 1 3/4 02/16/31	0	500	0	500 EUR	83.25%	416'250.00	0.07	a)
XS2443921056	0.6250 % IFXGR 0 5/8 02/17/25	0	100	0	100 EUR	94.06%	94'055.00	0.02	a)
XS2444263102	1.5600 % EXPNLN 1.56 05/16/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	83.53%	167'056.00	0.03	a)
XS2444424639	1.0000 % GM 1 02/24/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	94.47%	188'946.00	0.03	a)
XS2445374213	1.2060 % BJASST 1.206 02/23/25	0	300	0	300 EUR	93.66%	280'989.00	0.05	a)
XS2446386356	2.1030 % MS 2.103 05/08/26	0	500	0	500 EUR	95.69%	478'445.00	0.08	a)
XS2446386430	2.9500 % MS 2.95 05/07/32	0	500	0	500 EUR	89.36%	446'815.00	0.08	a)
XS2446843430	0.6250 % SIEGR 0 5/8 02/25/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	89.29%	89'291.00	0.02	a)
XS2446844594	1.0000 % SIEGR 1 02/25/30	0	100	0	100 EUR	84.64%	84'638.00	0.01	a)
XS2446846888	1.2500 % SIEGR 1 1/4 02/25/35 EMTN	0	200	0	200 EUR	76.53%	153'058.00	0.03	a)
XS2447561403	0.5000 % BMW 0 1/2 02/22/25 EMTN	0	150	0	150 EUR	94.48%	141'718.50	0.02	a)
XS2447564332	1.0000 % BMW 1 05/22/28 EMTN	0	250	0	250 EUR	88.25%	220'617.50	0.04	a)
XS2448001813	1.0990 % WSTPNZ 1.099 03/24/26 EMTN	0	250	0	250 EUR	91.19%	227'967.50	0.04	a)
XS2448014808	1.0000 % MA 1 02/22/29	0	350	0	350 EUR	86.52%	302'820.00	0.05	a)
XS2449330179	1.1250 % NOVOB 1 1/8 09/30/27 EMTN	0	150	0	150 EUR	90.36%	135'534.00	0.02	a)
XS2449911143	1.3750 % NWG 1 3/8 03/02/27 EMTN	0	350	0	350 EUR	89.65%	313'771.50	0.05	a)
XS2449928543	1.5000 % VWSDC 1 1/2 06/15/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	86.25%	172'492.00	0.03	a)
XS2449929517	2.0000 % VWSDC 2 06/15/34 EMTN	0	200	0	200 EUR	79.99%	159'970.00	0.03	a)
XS2450200741	1.2500 % UNANA 1 1/4 02/28/31 EMTN	0	250	0	250 EUR	84.68%	211'702.50	0.04	a)
XS2450200824	0.7500 % UNANA 0 3/4 02/28/26 EMTN	0	150	0	150 EUR	91.98%	137'965.50	0.02	a)
XS2451372499	1.2500 % ALDFP 1 1/4 03/02/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	91.60%	183'196.00	0.03	a)
XS2452433910	1.3750 % BSX 1 3/8 03/08/28	0	200	0	200 EUR	88.91%	177'818.00	0.03	a)
XS2452434645	1.6250 % BSX 1 5/8 03/08/31	0	250	0	250 EUR	84.25%	210'627.50	0.04	a)
XS2452435295	1.8750 % BSX 1 7/8 03/08/34	0	200	0	200 EUR	80.79%	161'578.00	0.03	a)
XS2454766473	0.7500 % BSX 0 3/4 03/08/25	0	350	0	350 EUR	93.90%	328'653.50	0.06	a)
XS2455983861	1.3750 % IBESM 1 3/8 03/11/32 EMTN	0	300	0	300 EUR	84.38%	253'149.00	0.04	a)
XS2456247605	0.7500 % BASGR 0 3/4 03/17/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	92.62%	277'869.00	0.05	a)
XS2456247787	1.5000 % BASGR 1 1/2 03/17/31	0	100	0	100 EUR	84.41%	84'405.00	0.01	a)
XS2456432413	4.8750 % RABOBK 4 7/8 PERP	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2457496359	1.5000 % AEMSPA 1 1/2 03/16/28 EMTN	0	150	0	150 EUR	87.70%	131'544.00	0.02	a)
XS2458285355	1.3750 % DSVDC 1 3/8 03/16/30 EMTN	0	180	0	180 EUR	84.48%	152'064.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2459163619	1.7500 % LXGR 1 3/4 03/22/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	89.31%	267'939.00	0.05	a)
XS2459544339	1.8750 % EDPL 1 7/8 09/21/29 EMTN	0	400	0	400 EUR	88.33%	353'316.00	0.06	a)
XS2461785185	2.0000 % CASTSS 2 03/24/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.58%	185'154.00	0.03	a)
XS2462321212	0.8750 % NESNVX 0 7/8 03/29/27 EMTN	0	150	0	150 EUR	90.88%	136'323.00	0.02	a)
XS2462321303	1.2500 % NESNVX 1 1/4 03/29/31 EMTN	0	250	0	250 EUR	84.42%	211'060.00	0.04	a)
XS2462321485	1.5000 % NESNVX 1 1/2 03/29/35 EMTN	0	250	0	250 EUR	79.61%	199'032.50	0.03	a)
XS2462323853	2.8240 % BAC 2.824 04/27/33 EMTN	0	550	0	550 EUR	88.47%	486'568.50	0.08	a)
XS2462324232	1.9490 % BAC 1.949 10/27/26 EMTN	0	600	0	600 EUR	94.19%	565'134.00	0.10	a)
XS2462324745	1.2500 % HLNLN 1 1/4 03/29/26 EMTN	0	350	0	350 EUR	92.12%	322'402.50	0.06	a)
XS2462324828	1.7500 % HLNLN 1 3/4 03/29/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	86.64%	173'272.00	0.03	a)
XS2462325122	2.1250 % HLNLN 2 1/8 03/29/34 EMTN	0	250	0	250 EUR	82.59%	206'482.50	0.04	a)
XS2462466611	1.5000 % AKZANA 1 1/2 03/28/28 EMTN	0	500	250	250 EUR	89.16%	222'897.50	0.04	a)
XS2462468740	2.0000 % AKZANA 2 03/28/32 EMTN	0	400	200	200 EUR	84.99%	169'972.00	0.03	a)
XS2463505581	0.8750 % EOANGR 0 7/8 01/08/25 EMTN	0	500	0	500 EUR	95.02%	475'105.00	0.08	a)
XS2463518998	1.6250 % EOANGR 1 5/8 03/29/31 EMTN	0	450	0	450 EUR	85.47%	384'633.00	0.07	a)
XS2464405229	2.2500 % AIB 2 1/4 04/04/28 EMTN	0	350	0	350 EUR	90.54%	316'890.00	0.05	a)
XS2464732770	2.7500 % STLA 2 3/4 04/01/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	86.63%	173'254.00	0.03	a)
XS2465984107	1.6310 % MIZUHO 1.631 04/08/27 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2465984289	1.8750 % BKIR 1 7/8 06/05/26 EMTN	0	400	0	400 EUR	94.16%	376'656.00	0.06	a)
XS2465984529	2.0960 % MIZUHO 2.096 04/08/32 EMTN	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2466172363	1.6250 % DTRGR 1 5/8 04/06/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	91.18%	182'360.00	0.03	a)
XS2466350993	1.9520 % TD 1.952 04/08/30 EMTN	0	500	0	500 EUR	86.17%	430'870.00	0.07	a)
XS2466358111	1.1250 % CADEPO 1 1/8 04/06/27 REGS	0	600	0	600 EUR	90.62%	543'732.00	0.09	a)
XS2466368938	1.5000 % DGELN 1 1/2 06/08/29 EMTN	0	250	0	250 EUR	88.34%	220'837.50	0.04	a)
XS2466401572	1.8750 % DGELN 1 7/8 06/08/34	0	300	0	300 EUR	82.47%	247'401.00	0.04	a)
XS2468223107	5.8000 % ASSGEN 5.8 07/06/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	104.75%	209'500.00	0.04	a)
XS2468378059	1.6250 % CABKSM 1 5/8 04/13/26 GMTN	0	200	0	200 EUR	93.97%	187'940.00	0.03	a)
XS2472603740	2.1250 % RY 2 1/8 04/26/29 EMTN	0	400	0	400 EUR	89.74%	358'948.00	0.06	a)
XS2473346299	2.0000 % NWIDE 2 04/28/27	0	200	0	200 EUR	92.73%	185'456.00	0.03	a)
XS2473687106	2.2500 % ASML 2 1/4 05/17/32	0	200	0	200 EUR	91.17%	182'330.00	0.03	a)
XS2473715675	2.7500 % BMO 2 3/4 06/15/27 EMTN	0	250	0	250 EUR	94.96%	237'402.50	0.04	a)
XS2475513953	1.8500 % ONTFFT 1.85 05/03/32 REGS	0	500	100	400 EUR	85.59%	342'352.00	0.06	a)
XS2475919663	2.5000 % ELTLX 2 1/2 05/18/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	88.19%	176'372.00	0.03	a)
XS2475954579	1.8750 % PHIANA 1 7/8 05/05/27 EMTN	0	250	0	250 EUR	92.39%	230'975.00	0.04	a)
XS2475955543	2.6250 % PHIANA 2 5/8 05/05/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	86.88%	173'756.00	0.03	a)
XS2475958059	2.1250 % PHIANA 2 1/8 11/05/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	88.63%	177'258.00	0.03	a)
XS2477935345	1.6250 % TENN 1 5/8 11/17/26 EMTN	0	350	0	350 EUR	93.66%	327'824.00	0.06	a)
XS2478299204	2.1250 % TENN 2 1/8 11/17/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	91.45%	274'359.00	0.05	a)
XS2478299469	2.7500 % TENN 2 3/4 05/17/42 EMTN	0	300	0	300 EUR	83.41%	250'227.00	0.04	a)
XS2478685931	2.2500 % UPMFH 2 1/4 05/23/29 EMTN	0	150	0	150 EUR	90.83%	136'248.00	0.02	a)
XS2478690931	1.7500 % SEB 1 3/4 11/11/26 GMTN	0	200	0	200 EUR	93.14%	186'288.00	0.03	a)
XS2479941499	1.5000 % V 1 1/2 06/15/26	0	450	450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2479941572	2.0000 % V 2 06/15/29	0	350	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2479942034	2.3750 % V 2 3/8 06/15/34	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2480515662	2.1250 % WURTH 2 1/8 08/23/30	0	200	0	200 EUR	89.47%	178'946.00	0.03	a)
XS2480958904	1.6250 % VLVY 1 5/8 09/18/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	94.76%	94'755.00	0.02	a)
XS2481287808	2.2500 % COLOBD 2 1/4 05/19/27 EMTN	0	270	0	270 EUR	93.62%	252'765.90	0.04	a)
XS2481288525	2.7500 % COLOBD 2 3/4 05/19/30 EMTN	0	230	0	230 EUR	92.39%	212'492.40	0.04	a)
XS2481498173	1.7500 % UNANA 1 3/4 11/16/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	90.91%	90'914.00	0.02	a)
XS2481498256	2.2500 % UNANA 2 1/4 05/16/34 EMTN	0	300	0	300 EUR	87.41%	262'215.00	0.05	a)
XS2482618464	2.5000 % NDASS 2 1/2 05/23/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	91.09%	273'273.00	0.05	a)
XS2482872251	2.8750 % FREGR 2 7/8 05/24/30 EMTN	0	150	0	150 EUR	88.49%	132'732.00	0.02	a)
XS2483607474	2.1250 % INTNED 2 1/8 05/23/26 EMTN	0	400	0	400 EUR	95.50%	382'000.00	0.07	a)
XS2484111047	2.1250 % NAB 2 1/8 05/24/28 GMTN	0	200	0	200 EUR	92.53%	185'064.00	0.03	a)
XS2484586669	1.7500 % MET 1 3/4 05/25/25 EMTN	0	150	0	150 EUR	95.62%	143'424.00	0.02	a)
XS2484587048	2.5920 % TELEFO 2.592 05/25/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	91.82%	91'817.00	0.02	a)
XS2485152362	2.1000 % SWEDA 2.1 05/25/27 EMTN	0	250	0	250 EUR	93.00%	232'492.50	0.04	a)
XS2485259241	1.7500 % BBVASM 1 3/4 11/26/25 GMTN	0	400	0	400 EUR	94.40%	377'608.00	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2485265214	3.1250 % PRIFI 3 1/8 06/01/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	88.79%	177'580.00	0.03	a)
XS2485360981	2.5000 % HERIM 2 1/2 05/25/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	91.17%	273'513.00	0.05	a)
XS2486092492	1.6250 % DNBNO 1 5/8 05/31/26 EMTN	0	250	0	250 EUR	94.63%	236'562.50	0.04	a)
XS2486285294	2.3750 % MCD 2 3/8 05/31/29 GMTN	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2486285377	3.0000 % MCD 3 05/31/34 GMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2486461523	3.2450 % NGGLN 3.245 03/30/34 EMTN	0	200	0	200 EUR	89.12%	178'244.00	0.03	a)
XS2486589596	3.0190 % HSBC 3.019 06/15/27	0	600	0	600 EUR	95.42%	572'490.00	0.10	a)
XS2487052487	4.2500 % AXASA 4 1/4 03/10/43 EMTN	0	300	0	300 EUR	92.63%	277'875.00	0.05	a)
XS2487054004	2.3750 % ABNANV 2 3/8 06/01/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.23%	93'229.00	0.02	a)
XS2487054939	3.0000 % ABNANV 3 06/01/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	90.98%	181'952.00	0.03	a)
XS2489287354	2.1250 % SANDSS 2 1/8 06/07/27 EMTN	0	150	0	150 EUR	93.92%	140'877.00	0.02	a)
XS2489772991	4.5000 % HESLAN 4 1/2 09/15/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.00%	190'000.00	0.03	a)
XS2490472102	2.8750 % ORSTED 2 7/8 06/14/33 EMTN	0	250	0	250 EUR	90.01%	225'020.00	0.04	a)
XS2491029380	2.3750 % MRKGR 2 3/8 06/15/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	93.07%	186'136.00	0.03	a)
XS2491542374	3.1250 % BASGR 3 1/8 06/29/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.28%	194'556.00	0.03	a)
XS2491542457	3.7500 % BASGR 3 3/4 06/29/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	98.41%	98'411.00	0.02	a)
XS2491664137	4.0000 % ERFFP 4 07/06/29	0	200	0	200 EUR	96.27%	192'532.00	0.03	a)
XS2491963638	3.6250 % AIB 3 5/8 07/04/26	0	200	0	200 EUR	98.04%	196'080.00	0.03	a)
XS2494945939	3.8750 % RTOLN 3 7/8 06/27/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	99.23%	297'681.00	0.05	a)
XS2494946820	4.3750 % RTOLN 4 3/8 06/27/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.46%	200'918.00	0.03	a)
XS2496288593	3.0000 % UNIMUS 3 06/30/27 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2496289138	3.7500 % UNIMUS 3 3/4 06/30/32 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2498554992	4.0000 % ALDFP 4 07/05/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.19%	198'386.00	0.03	a)
XS2511301322	2.5510 % TD 2.551 08/03/27 EMTN	0	235	0	235 EUR	93.60%	219'952.95	0.04	a)
XS2511309903	3.1290 % TD 3.129 08/03/32 EMTN	0	350	0	350 EUR	91.63%	320'694.50	0.06	a)
XS2511906310	3.7500 % SEGPLP 3 3/4 08/10/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.28%	190'564.00	0.03	a)
XS2517103334	2.6250 % SGOFF 2 5/8 08/10/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	90.07%	180'132.00	0.03	a)
XS2517103417	2.1250 % SGOFF 2 1/8 06/10/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	92.01%	92'013.00	0.02	a)
XS2521027446	3.1250 % LLOYDS 3 1/8 08/24/30 EMTN	0	250	0	250 EUR	92.29%	230'727.50	0.04	a)
XS2521820048	2.0000 % VLVY 2 08/19/27 EMTN	0	150	0	150 EUR	92.54%	138'808.50	0.02	a)
XS2522879654	3.6250 % SWEDA 3 5/8 08/23/32 GMTN	0	200	0	200 EUR	92.88%	185'750.00	0.03	a)
XS2524143554	3.8750 % RABOBK 3 7/8 11/30/32 GMTN	0	200	0	200 EUR	94.63%	189'250.00	0.03	a)
XS2524740649	2.8750 % NDASS 2 7/8 08/24/32 EMTN	0	250	0	250 EUR	91.11%	227'765.00	0.04	a)
XS2524746687	4.1250 % INTNED 4 1/8 08/24/33	0	300	0	300 EUR	94.50%	283'500.00	0.05	a)
XS2525226622	3.5300 % SANUK 3.53 08/25/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.00%	190'000.00	0.03	a)
XS2525246901	3.2500 % NWIDE 3 1/4 09/05/29 EMTN	0	250	0	250 EUR	94.61%	236'512.50	0.04	a)
XS2526828996	2.8750 % EOANGR 2 7/8 08/26/28 EMTN	0	350	0	350 EUR	95.67%	334'848.50	0.06	a)
XS2526839258	2.5000 % SIEGR 2 1/2 09/08/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	95.71%	95'708.00	0.02	a)
XS2526839506	3.0000 % SIEGR 3 09/08/33 EMTN	0	300	0	300 EUR	94.48%	283'431.00	0.05	a)
XS2526839761	2.7500 % SIEGR 2 3/4 09/09/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	94.37%	188'746.00	0.03	a)
XS2527421668	3.0000 % JCI 3 09/15/28	0	200	0	200 EUR	94.98%	189'954.00	0.03	a)
XS2527786755	2.1250 % VLVY 2 1/8 09/01/24 EMTN	0	150	0	150 EUR	97.46%	146'184.00	0.03	a)
XS2528582377	3.0000 % CPGLN 3 03/08/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.16%	190'328.00	0.03	a)
XS2528858033	4.0670 % NWG 4.067 09/06/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	98.19%	294'576.00	0.05	a)
XS2529233814	4.7500 % ISPIM 4 3/4 09/06/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.09%	200'174.00	0.03	a)
XS2529520715	3.6250 % PRIFI 3 5/8 03/07/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.85%	93'853.00	0.02	a)
XS2530034649	3.7500 % CABKSM 3 3/4 09/07/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.94%	195'874.00	0.03	a)
XS2530219349	2.6250 % HENKEL 2 5/8 09/13/27	0	200	0	200 EUR	96.69%	193'382.00	0.03	a)
XS2531420730	2.6250 % ALLRNV 2 5/8 09/09/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	96.45%	96'454.00	0.02	a)
XS2531438351	2.5000 % DE 2 1/2 09/14/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	96.30%	192'600.00	0.03	a)
XS2531569965	3.2500 % ORSTED 3 1/4 09/13/31 EMTN	0	300	0	300 EUR	95.47%	286'398.00	0.05	a)
XS2532312548	2.8750 % STATK 2 7/8 09/13/29 EMTN	0	250	0	250 EUR	96.09%	240'232.50	0.04	a)
XS2534276717	2.6250 % VLVY 2 5/8 02/20/26 EMTN	0	250	0	250 EUR	96.69%	241'725.00	0.04	a)
XS2534785865	3.3750 % BBVASM 3 3/8 09/20/27 GMTN	0	400	0	400 EUR	96.88%	387'520.00	0.07	a)
XS2534786590	7.3750 % RBLAV 7 3/8 12/20/32	0	100	0	100 EUR	97.75%	97'750.00	0.02	a)
XS2534891978	3.2500 % KNOGR 3 1/4 09/21/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.19%	194'384.00	0.03	a)
XS2534976886	4.5000 % AEMSPA 4 1/2 09/19/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.95%	100'951.00	0.02	a)
XS2534985523	3.1250 % DNBNO 3 1/8 09/21/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.38%	194'750.00	0.03	a)
XS2535307743	2.6250 % MDT 2 5/8 10/15/25	0	100	0	100 EUR	97.41%	97'412.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2535308477	3.0000 % MDT 3 10/15/28	0	350	0	350 EUR	96.05%	336'171.50	0.06	a)
XS2535308634	3.1250 % MDT 3 1/8 10/15/31	0	350	0	350 EUR	94.92%	332'230.50	0.06	a)
XS2535309798	3.3750 % MDT 3 3/8 10/15/34	0	300	0	300 EUR	94.28%	282'831.00	0.05	a)
XS2535724772	4.0000 % VGASDE 4 09/26/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.45%	301'350.00	0.05	a)
XS2535725159	4.6250 % VGASDE 4 5/8 09/26/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	103.27%	103'271.00	0.02	a)
XS2536362622	4.1120 % C 4.112 09/22/33	0	300	0	300 EUR	96.96%	290'877.00	0.05	a)
XS2536364081	3.7130 % C 3.713 09/22/28	0	300	0	300 EUR	97.63%	292'887.00	0.05	a)
XS2536502227	4.0000 % GS 4 09/21/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	97.80%	293'388.00	0.05	a)
XS2536941656	4.2500 % ABNANV 4 1/4 02/21/30 EMTN	0	400	0	400 EUR	98.96%	395'844.00	0.07	a)
XS2537251170	3.7500 % AXASA 3 3/4 10/12/30 EMTN	0	250	0	250 EUR	100.49%	251'232.50	0.04	a)
XS2538366878	3.6250 % SANTAN 3 5/8 09/27/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	98.48%	196'966.00	0.03	a)
XS2538368221	3.7500 % SANDSS 3 3/4 09/27/29 EMTN	0	150	0	150 EUR	98.95%	148'422.00	0.03	a)
XS2540585564	4.1250 % ELTLX 4 1/8 10/05/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.29%	200'578.00	0.03	a)
XS2545206166	4.3750 % BBVASM 4 3/8 10/14/29 GMTN	0	400	0	400 EUR	100.97%	403'896.00	0.07	a)
XS2545248242	3.7500 % VATFAL 3 3/4 10/18/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.07%	100'070.00	0.02	a)
XS2545259876	4.5000 % DELL 4 1/2 10/18/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.41%	200'816.00	0.03	a)
XS2545263399	3.2500 % CARLB 3 1/4 10/12/25 EMTN	0	150	0	150 EUR	98.82%	148'228.50	0.03	a)
XS2545759099	5.2500 % ISPIM 5 1/4 01/13/30 EMTN	0	250	0	250 EUR	102.83%	257'077.50	0.04	a)
XS2546781555	4.1250 % OPBANK 4 1/8 04/18/27 EMTN	0	150	0	150 EUR	101.38%	152'065.50	0.03	a)
XS2547609433	4.0000 % TALANX 4 10/25/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.96%	199'922.00	0.03	a)
XS2547936984	5.7500 % RBAIV 5 3/4 01/27/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.57%	205'130.00	0.04	a)
XS2548080832	4.8130 % MS 4.813 10/25/28	0	350	0	350 EUR	101.71%	355'974.50	0.06	a)
XS2548081053	5.1480 % MS 5.148 01/25/34 GMTN	0	600	0	600 EUR	103.69%	622'164.00	0.11	a)
XS2549543143	3.8750 % TENN 3 7/8 10/28/28 EMTN	0	250	0	250 EUR	101.38%	253'437.50	0.04	a)
XS2549543226	4.2500 % TENN 4 1/4 04/28/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.89%	207'774.00	0.04	a)
XS2549543499	4.5000 % TENN 4 1/2 10/28/34 EMTN	0	300	0	300 EUR	106.03%	318'084.00	0.05	a)
XS2549715618	4.7500 % TENN 4 3/4 10/28/42 EMTN	0	300	0	300 EUR	106.59%	319'767.00	0.06	a)
XS2549815913	5.8750 % HANRUE 5 7/8 08/26/43	0	200	0	200 EUR	104.25%	208'500.00	0.04	a)
XS2550081454	4.6250 % RABOBK 4 5/8 01/27/28 GMTN	0	300	0	300 EUR	101.00%	303'000.00	0.05	a)
XS2550909415	4.0000 % ESBIRE 4 05/03/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.36%	200'718.00	0.03	a)
XS2552362704	4.7000 % GWOCN 4.7 11/16/29	0	200	0	200 EUR	102.37%	204'746.00	0.04	a)
XS2553547444	6.3640 % HSBC 6.364 11/16/32	0	300	0	300 EUR	103.12%	309'345.00	0.05	a)
XS2553798443	4.0000 % SEB 4 11/09/26	0	300	0	300 EUR	99.92%	299'745.00	0.05	a)
XS2553801502	5.1250 % SABSM 5 1/8 11/10/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.88%	203'750.00	0.04	a)
XS2553817763	3.1250 % GSK 3 1/8 11/28/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	94.98%	189'966.00	0.03	a)
XS2554581830	7.0000 % ASARNED 7 12/07/43	0	250	0	250 EUR	105.00%	262'500.00	0.05	a)
XS2554745708	5.2500 % INTNED 5 1/4 11/14/33	0	300	0	300 EUR	103.75%	311'250.00	0.05	a)
XS2554746185	4.8750 % INTNED 4 7/8 11/14/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.50%	203'000.00	0.03	a)
XS2554997937	4.7500 % COVEGR 4 3/4 11/15/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.72%	100'715.00	0.02	a)
XS2555178644	3.0000 % ADSGR 3 11/21/25	0	100	0	100 EUR	97.87%	97'868.00	0.02	a)
XS2555179378	3.1250 % ADSGR 3 1/8 11/21/29	0	100	0	100 EUR	96.72%	96'724.00	0.02	a)
XS2555187801	5.3750 % CABKSM 5 3/8 11/14/30 EMTN	0	300	0	300 EUR	102.81%	308'427.00	0.05	a)
XS2555192710	3.7500 % SWEDA 3 3/4 11/14/25 EMTN	0	150	0	150 EUR	99.48%	149'220.00	0.03	a)
XS2555196463	3.0000 % NESNVX 3 03/15/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	98.50%	196'998.00	0.03	a)
XS2555198089	3.2500 % NESNVX 3 1/4 01/15/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	98.12%	196'234.00	0.03	a)
XS2555198162	3.3750 % NESNVX 3 3/8 11/15/34 EMTN	0	150	0	150 EUR	97.58%	146'376.00	0.03	a)
XS2555412001	6.6930 % CESSPO 6.693 11/14/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	102.18%	102'175.00	0.02	a)
XS2555420103	5.8500 % UCGIM 5.85 11/15/27 EMTN	0	500	0	500 EUR	102.32%	511'580.00	0.09	a)
XS2555925218	5.7500 % AIB 5 3/4 02/16/29	0	250	0	250 EUR	103.36%	258'405.00	0.04	a)
XS2557084733	4.5000 % ABNANV 4 1/2 11/21/34	0	300	0	300 EUR	99.10%	297'294.00	0.05	a)
XS2558022591	5.1250 % ABNANV 5 1/8 02/22/33 EMTN	0	300	0	300 EUR	99.13%	297'375.00	0.05	a)
XS2558395278	4.0490 % ENBW 4.049 11/22/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.69%	201'380.00	0.03	a)
XS2558916693	3.1250 % IBESM 3 1/8 11/22/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.86%	195'710.00	0.03	a)
XS2558953621	3.2500 % SEB 3 1/4 11/24/25 GMTN	0	100	0	100 EUR	98.27%	98'271.00	0.02	a)
XS2558966953	3.3750 % IBESM 3 3/8 11/22/32 EMTN	0	300	0	300 EUR	97.49%	292'455.00	0.05	a)
XS2558978883	6.2500 % CABKSM 6 1/4 02/23/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.75%	203'500.00	0.04	a)
XS2559580548	4.2500 % FREGR 4 1/4 05/28/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.43%	198'856.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2560328648	4.6250 % DNBNO 4 5/8 02/28/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	98.25%	196'500.00	0.03	a)
XS2560753936	3.5000 % BERTEL 3 1/2 05/29/29	0	300	0	300 EUR	97.54%	292'629.00	0.05	a)
XS2561647368	4.6250 % LIBMUT 4 5/8 12/02/30 REGS	0	200	0	200 EUR	98.18%	196'368.00	0.03	a)
XS2561748711	3.7500 % MET 3 3/4 12/05/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	98.72%	197'438.00	0.03	a)
XS2565831943	3.6310 % TD 3.631 12/13/29 EMTN	0	350	0	350 EUR	96.05%	336'178.50	0.06	a)
XS2572476864	3.6250 % NYLIFE 3 5/8 01/09/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.10%	99'103.00	0.02	a)
XS2573331324	3.6250 % ABNANV 3 5/8 01/10/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.42%	198'844.00	0.03	a)
XS2574873183	3.8750 % EOANGR 3 7/8 01/12/35 EMTN	0	300	0	300 EUR	96.91%	290'730.00	0.05	a)
XS2574873266	3.5000 % EOANGR 3 1/2 01/12/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	98.94%	296'826.00	0.05	a)
XS2575555938	3.2500 % ABBNVX 3 1/4 01/16/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	98.75%	197'506.00	0.03	a)
XS2575556589	3.3750 % ABBNVX 3 3/8 01/16/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.16%	97'159.00	0.02	a)
XS2575952424	3.7500 % SANTAN 3 3/4 01/16/26 EMTN	0	400	0	400 EUR	99.05%	396'212.00	0.07	a)
XS2575952697	3.8750 % SANTAN 3 7/8 01/16/28 EMTN	0	400	0	400 EUR	98.43%	393'716.00	0.07	a)
XS2575952937	3.7990 % WSTP 3.799 01/17/30 EMTN	0	150	0	150 EUR	98.33%	147'496.50	0.03	a)
XS2575965327	3.7500 % MASSMU 3 3/4 01/19/30 GMTN	0	100	0	100 EUR	98.73%	98'729.00	0.02	a)
XS2575971994	4.0000 % ABNANV 4 01/16/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	98.54%	295'608.00	0.05	a)
XS2577053825	4.8000 % UC GIM 4.8 01/17/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.01%	300'042.00	0.05	a)
EUR							572'854'495.64	98.65	

Derivative Finanzinstrumente

0.00 0.00

Devisentermingeschäfte

CHF/EUR	Verfall	07.06.2022	6'115'440	6'280'000	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	08.06.2022	3'278'169	3'370'000	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	28.12.2022	5'400'000	5'492'382	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	29.12.2022	205'000	207'882	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	03.01.2023	324'621	320'000	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	04.01.2023	1'015'295	1'000'000	EUR/CHF	0.00	0.00

Devisentermingeschäfte

0.00 0.00

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

EUR/CHF	Verfall	04.04.2022	23'864'793	23'163'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	04.04.2022	110'604	108'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	04.05.2022	23'492'964	22'946'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	04.05.2022	195'178	191'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	04.05.2022	23'137'000	23'694'070	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	07.06.2022	23'080'889	22'542'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	07.06.2022	47'000	48'336	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	07.06.2022	22'495'000	23'100'318	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	04.07.2022	22'801'609	22'206'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	04.07.2022	128'000	130'327	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	03.08.2022	21'889'878	21'866'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	03.08.2022	13'000	13'016	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	02.09.2022	22'759'908	23'442'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	02.09.2022	88'518	91'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	04.10.2022	22'022'148	22'450'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	04.10.2022	153'000	149'666	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	04.10.2022	22'297'000	21'500'551	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	02.11.2022	21'270'007	22'070'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	02.11.2022	108'000	104'977	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	02.11.2022	51'455	52'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	02.11.2022	22'014'000	21'775'809	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	02.12.2022	21'169'916	21'426'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	02.12.2022	65'050	66'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	02.12.2022	21'492'000	21'081'933	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	04.01.2023	21'697'353	22'157'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	04.01.2023	84'558	86'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	04.01.2023	1'222'296	1'241'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	04.01.2023	23'484'000	23'191'155	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	02.02.2023	22'681'675	22'993'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	02.02.2023	135'567	137'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	02.02.2023	278'000	273'749	EUR/CHF	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		22'852'000	22'799'897		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		22'856'675	22'937'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		169'563	170'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		23'107'000	22'969'051		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		22'693'540	22'868'000		CHF/EUR	0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							0.00	0.00	

Vermögensaufstellung	Kurswert EUR	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	2'429'376.95	0.42
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	572'854'495.64	98.65
Sonstige Vermögenswerte	5'387'123.86	0.93
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	580'670'996.45	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-270.22	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	580'670'726.23	

Bewertungskategorien	Kurswert EUR	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	572'854'495.64	98.65
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

CHF	1 = EUR	1.00608162
-----	---------	------------

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	EUR	22'831'553.52	3.932
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	EUR	-	-

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2022 - 28.02.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
FA EUR	EUR	0.00 - 0.50	-	0.413	0.00 - 0.10	-	0.005
NT EUR	EUR	0.00 - 0.50	-	0.413	0.00 - 0.10	-	0.005
NTH1 CHF	EUR	0.00 - 0.50	-	0.413	0.00 - 0.10	-	0.005

Die Anleger können Angaben über die Höhe der effektiv belasteten Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen bei der Fondsleitung beziehen. Die Berechnung der Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen ist im Fondsvertrag § 19 Ziff. 3 geregelt.

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	EUR	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	EUR	-
Andere Wertpapiere	EUR	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	EUR	-

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich sogenannten «soft commissions» geschlossen.

7 Pauschale Verwaltungskommission

Die pauschale Verwaltungskommission (PVK) wird verwendet für die Leitung, die Entschädigung der Depotbank (PAF) für die von ihr erbrachten Dienstleistungen, wie auch für das Asset Management und den Vertrieb (PMF) des Teilvermögens.

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.03.2022 - 28.02.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
FA EUR	0.200	0.500	0.100	0.100	3.000
NT EUR	-	-	-	-	3.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	3.000

Gemäss den Verhaltensregeln der Asset Management Association Switzerland vom 5. August und 23. September 2021 (in Kraft 1. Januar 2022): Aus der pauschalen Verwaltungskommission können Gebühren bzw. Entschädigungen (inkl. Retrozessionen) zur Deckung der Vertriebstätigkeit des Fonds bezahlt werden. Als Vertriebstätigkeit gilt insbesondere jede Tätigkeit in Zusammenhang mit dem Angebot, der Werbung und der Vermittlung des Fonds. Die Gesellschaft bzw. die Fondsleitung kann Anlegern aufgrund objektiver Kriterien Rabatte auf den dem Fonds belasteten Gebühren bzw. Kosten gewähren.

8 Benchmark

FTSE World Broad Investment-Grade Euro Corporate Bond Index TR

9 TER

Die TER wurde gemäss «Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der TER von kollektiven Kapitalanlagen», die von der AMAS - Asset Management Association Switzerland (Stand: 5. August 2021) herausgegeben wurden, ermittelt.

10 Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 21.06.2023

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.06.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
FA EUR	Ja	EUR	1.25000	0.43750	0.81250

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 21.06.2023

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.06.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
NT EUR	Ja	EUR	1.839	0.643	1.196
NTH1 CHF	Ja	EUR	1.400	0.490	0.910

12 Fussnoten

- 1) Der Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens, berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten, aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 0.0001 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle zum Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit der Rechnungseinheit japanischer Yen (JPY) wird der Nettoinventarwert auf 0.01 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, 0.0001 der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle zum Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen dieses Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen

Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;

- c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
- d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettofondsvermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Mitteilung an die Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund V

Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

(im Folgenden "der Umbrella-Fonds")

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH
Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada
Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH
Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Domestic CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Foreign CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund USA Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World ex EUR/USD
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect
Swisscanto (CH) Index Commodity Fund hedged CHF

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigen den Fondsvertrag des Umbrella-Fonds unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA in Bezug auf die Bezeichnung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Commodity Fund hedged CHF wie folgt zu ändern:

Umbenennung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Commodity Fund hedged CHF

Aktuelle Bezeichnung	Neue Bezeichnung
Swisscanto (CH) Index Commodity Fund hedged CHF	Swisscanto (CH) Index Commodity Fund

Die Bezeichnung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Commodity Fund hedged CHF (neu: Swisscanto (CH) Index Commodity Fund) wird im gesamten Fondsvertrag des Umbrella-Fonds entsprechend angepasst und der erste Satz in § 8 Ziff. 32 des Fondsvertrages des Umbrella-Fonds lautet neu entsprechend wie folgt: "Das Teilvermögen bildet grundsätzlich den Referenzindex Bloomberg Commodity Index nach."

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

Die Anleger werden darauf hingewiesen, dass gegen die vorliegend umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages keine Einwendungen erhoben werden können, da es sich bei den Änderungen um rein formelle Anpassungen handelt.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, der Jahres- und Halbjahresbericht des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V, die wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 15. Juni 2022

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich



Mitteilung an die Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund V

ein vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

(nachfolgend „der Umbrella-Fonds“)

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Domestic CHF

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Foreign CHF

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF Responsible

Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund USA Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF

(neu: Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked)

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World ex EUR/USD

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect
Swisscanto (CH) Index Commodity Fund

(nachfolgend „die Teilvermögen“)

Die Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen, den Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zu ändern.

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF wird umbenannt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Sodann werden bestehende Anteilsklassen umbenannt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Überdies erfolgt eine Anpassung bei einer Risikoverteilungsvorschrift (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 3 dieser Veröffentlichung).

Ausserdem sollen die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect, Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect und Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect oder eine Anteilsklasse dieser Teilvermögen neu einem Soft Closing unterzogen werden können (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 4 dieser Veröffentlichung).

Weiter wird beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect neu eine Bestimmung betreffend Gating aufgenommen und beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. eine Präzisierung bei der bestehenden Gating-Bestimmung vorgenommen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 5 dieser Veröffentlichung).

Schliesslich wird die Umwandlung im Fondsvertrag neu nicht mehr geregelt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 6 dieser Veröffentlichung).

Neben den nachfolgend umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags werden einzelne Anpassungen des Fondsvertrags formeller Natur (insbesondere Anpassungen in Zusammenhang mit dem Finanzdienstleistungsgesetz (FIDLEG) bzw. dem Finanzinstitutsgesetz (FINIG)) vorgenommen.

1. Umbenennung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF

Aktuelle Bezeichnung	Neue Bezeichnung
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked

Die Bezeichnung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF (neu: Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked) wird im gesamten Fondsvertrag des Umbrella-Fonds entsprechend angepasst und der erste Satz in § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages des Umbrella-Fonds

lautet neu entsprechend wie folgt: "Das Teilvermögen bildet grundsätzlich den Referenzindex FTSE Non-JPY World Inflation-Linked Securities Index nach."

2. Umbenennung von Anteilsklassen

Die bestehenden Anteilsklassen mit Währungsabsicherung der Teilvermögen werden wie folgt umbenannt (vgl. § 6 Ziff. 4 und § 20 Ziff. 1 des Fondsvertrages):

Bisherige Anteilsklassenbezeichnung	Neue Anteilsklassenbezeichnung
FTH CHF	FTH1 CHF
FTH EUR	FTH1 EUR
FTH GBP	FTH1 GBP
FTH USD	FTH1 USD
FAH CHF	FAH1 CHF
FAH EUR	FAH1 EUR
FAH GBP	FAH1 GBP
FAH USD	FAH1 USD
CTH CHF	CTH1 CHF
CTH EUR	CTH1 EUR
CTH GBP	CTH1 GBP
CTH USD	CTH1 USD
CAH CHF	CAH1 CHF
CAH EUR	CAH1 EUR
CAH GBP	CAH1 GBP
CAH USD	CAH1 USD
DTH CHF	DTH1 CHF
DTH EUR	DTH1 EUR
DTH GBP	DTH1 GBP
DTH USD	DTH1 USD
DAH CHF	DAH1 CHF
DAH EUR	DAH1 EUR
DAH GBP	DAH1 GBP

DAH USD	DAH1 USD
GTH CHF	GTH1 CHF
GTH EUR	GTH1 EUR
GTH GBP	GTH1 GBP
GTH USD	GTH1 USD
GAH CHF	GAH1 CHF
GAH EUR	GAH1 EUR
GAH GBP	GAH1 GBP
GAH USD	GAH1 USD
MTH CHF	MTH1 CHF
MTH EUR	MTH1 EUR
MTH GBP	MTH1 GBP
MTH USD	MTH1 USD
MAH CHF	MAH1 CHF
MAH EUR	MAH1 EUR
MAH GBP	MAH1 GBP
MAH USD	MAH1 USD
NTH CHF	NTH1 CHF
NTH EUR	NTH1 EUR
NTH GBP	NTH1 GBP
NTH USD	NTH1 USD
NAH CHF	NAH1 CHF
NAH EUR	NAH1 EUR
NAH GBP	NAH1 GBP
NAH USD	NAH1 USD
STH CHF	STH1 CHF
STH EUR	STH1 EUR
STH GBP	STH1 GBP

STH USD	STH1 USD
SAH CHF	SAH1 CHF
SAH EUR	SAH1 EUR
SAH GBP	SAH1 GBP
SAH USD	SAH1 USD

3. Anpassung Risikoverteilungsvorschrift

§ 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages lautet neu wie folgt:

"Die Fondsleitung darf keine Beteiligungsrechte erwerben, die insgesamt mehr als 10% der Stimmrechte ausmachen oder die es ihr erlauben, einen wesentlichen Einfluss auf die Geschäftsleitung eines Emittenten auszuüben. Vorbehalten bleiben die durch die Aufsichtsbehörde gewährten Ausnahmen."

4. Soft Closing

Für die Teilvermögen **Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect**, **Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect** und **Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect** wird eine neue Bestimmung betreffend Soft Closing aufgenommen (vgl. neue Ziff. 8 in § 5 des Fondsvertrages).

Die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect, Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect und Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect oder eine Anteilsklasse dieser Teilvermögen können einem "Soft Closing" unterzogen werden, wonach Anleger keine Anteile zeichnen können, wenn die Schließung nach Auffassung der Fondsleitung notwendig ist, um die Interessen der bestehenden Anleger zu schützen. Das Soft Closing gilt in Bezug auf die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect, Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect und Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect oder Anteilsklassen dieser Teilvermögen für neue Zeichnungen oder Wechsel in das jeweilige Teilvermögen oder die jeweilige Anteilsklasse, jedoch nicht für Rücknahmen, Übertragungen oder Wechsel aus dem jeweiligen Teilvermögen oder der jeweiligen Anteilsklasse des jeweiligen Teilvermögens heraus. Die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect, Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect und Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect oder eine Anteilsklasse dieser Teilvermögen können ohne Benachrichtigung der Anleger einem Soft Closing unterzogen werden.

5. Gating

Für das Teilvermögen **Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect** wird eine neue Bestimmung betreffend Gating aufgenommen (vgl. neue Ziff. 10 in § 17 des Fondsvertrages).

Beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect behält sich die Fondsleitung unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. bei einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der gehaltenen Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettorücknahmen, im Interesse der im Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect verbleibenden Anleger, die Herabsetzung aller Rücknahmeanträge (Gating bei einem Rücknahmeüberhang) an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettorücknahmen den Schwellenwert von CHF 10 Mio. übersteigt. Gleichsam behält sich die Fondsleitung beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der zu erwerbenden Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettozeichnungen, im Interesse der im Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect verbleibenden Anleger, die Herabsetzung aller Zeichnungsanträge (Gating bei einem Zeichnungsüberhang)

an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettozeichnungen den Schwellenwert von CHF 10 Mio. übersteigt. Unter diesen Umständen kann die Fondsleitung entscheiden, alle Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge proportional und im gleichen Verhältnis nach eigenem Ermessen zu kürzen. Der verbleibende Teil der Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge ist als für den nächsten Bewertungstag eingegangen zu betrachten und wird zu den an diesem Tag geltenden Bedingungen abgewickelt. Die Fondsleitung sorgt dafür, dass keine bevorzugte Behandlung aufgeschobener Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge stattfindet.

Die Fondsleitung teilt den Entscheid über die Anwendung sowie die Aufhebung des Gatings unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den Anlegern mit.

Beim Teilvermögen **Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.** besteht bereits eine Bestimmung betreffend Gating, welche neu leicht präzisiert wird (vgl. bestehende Ziff. 8 in § 17 des Fondsvertrages).

Beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. behält sich die Fondsleitung unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. bei einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der gehaltenen Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettorücknahmen, im Interesse der im Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. verbleibenden Anleger, die Herabsetzung aller Rücknahmeanträge (Gating bei einem Rücknahmeüberhang) an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Rücknahmen netto 15% des Fondsvermögens übersteigt. Unter diesen Umständen kann die Fondsleitung entscheiden, alle Rücknahmeanträge proportional und im gleichen Verhältnis nach eigenem Ermessen zu kürzen. Der verbleibende Teil der Rücknahmeaufträge ist als für den nächsten Bewertungstag eingegangen zu betrachten und wird zu den an diesem Tag geltenden Bedingungen abgewickelt. Eine bevorzugte Behandlung aufgeschobener Rücknahmeanträge findet somit nicht statt.

Die Fondsleitung teilt den Entscheid über die Anwendung sowie die Aufhebung des Gatings unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den Anlegern mit.

6. Keine Regelung der Umwandlung mehr

Bisher wurde in § 25 des Fondsvertrages nebst der Vereinigung und Spaltung auch die Umwandlung geregelt. Die betreffenden Angaben betreffend die Umwandlung werden nun entfernt (vgl. die Streichung in der Überschrift von § 25 des Fondsvertrages und in § 25 Ziff. 9 des Fondsvertrages).

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA lediglich auf die in Ziff. 1 – 5 der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags erstreckt.

Die Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie innert 30 Tagen ab dem Zeitpunkt dieser Veröffentlichung bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern, gegen die in dieser Veröffentlichung erwähnten Änderungen des Fondsvertrags Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrags in bar verlangen können.

Kein Einwendungsrecht besteht gegen die in Ziff. 3 umschriebenen Änderungen, da es sich bei den Änderungen um rein formelle Anpassungen handelt.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, der Jahres- und Halbjahresbericht, die wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 29. Juni 2022

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund V

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"
(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

Zurzeit mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA
Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada
Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH
Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Domestic CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Foreign CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund USA Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World ex EUR/USD
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect
Swisscanto (CH) Index Commodity Fund
(nachfolgend die "Teilvermögen")

Die Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen, den Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zu ändern.

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible soll repositioniert werden und neu unter anderem als Dachfonds ausgerichtet werden, was insbesondere mit Änderungen der Anlagepolitik, Risikoverteilung und mit Anpassungen bei der Bestimmung betreffend die Laufzeit der Teilvermögen und Auflösung verbunden ist (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Zudem sollen die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible künftig als Zielfonds von anderen kollektiven Kapitalanlagen der Swisscanto Fondsleitung AG dienen. Die diesbezüglichen Anpassungen des Fondsvertrages werden unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung aufgeführt.

Schliesslich soll das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible umbenannt werden (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 3 dieser Veröffentlichung).

Neben den nachfolgend umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags werden einzelne Anpassungen des Fondsvertrags formeller Natur vorgenommen.

1 Repositionierung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible

In § 8 Ziff. 15 des Fondsvertrages ist geregelt, dass das Teilvermögen grundsätzlich den Referenzindex MSCI World ex Switzerland Index nachbildet. Neu wird diese Bestimmung ergänzt, in dem ausgeführt wird, dass dies mittels indirekten und direkten Anlagen erfolgen kann. In diesem Zusammenhang wird in § 18 Ziff. 15 lit. b des angepassten Fondsvertrages eine Limite aufgenommen, wonach die Fondsleitung höchstens 30% des Vermögens des Teilvermögens direkt investieren darf. Betreffend diese Investitionen geltend die Bestimmungen gemäss lit. ba – bd des angepassten Fondsvertrages.

Zudem wird neu ausgeführt, dass das Teilvermögen in die Swisscanto-Zielfonds Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible investieren kann (vgl. die Anpassungen in lit. a von § 8 Ziff. 15 des angepassten Fondsvertrags). Ebenfalls wird unter der gleichen Bestimmung neu normiert, dass Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen Dachfonds (Funds of Funds) ausdrücklich ausgeschlossen sind.

Ebenfalls wird in lit. b von § 8 Ziff. 15 des angepassten Fondsvertrags die Bestimmung gestrichen, wonach die Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen kollektiven Kapitalanlagen 10% des Vermögens des Teilvermögens nicht überschreiten dürfen.

Das Teilvermögen soll zudem neu als Dachfonds ausgestaltet werden, welches in diverse Swisscanto-Zielfonds investieren kann (betreffend Zielfonds siehe dazu auch die Ausführungen unter nachstehender Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Einhergehend mit der Repositionierung zum Dachfonds wird in Ziff. 13 von § 15 des Fondsvertrages auch für das Teilvermögen insbesondere eine entsprechende Ergänzung aufgenommen, wonach die in Ziff. 13 erwähnte Grenze von 25% der Anteile bzw. Aktien an anderen kollektiven Kapitalanlagen auf 100% angehoben ist für die Investitionen in die Zielfonds Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible.

Zudem findet künftig für das Teilvermögen die Regelung in § 15 Ziff. 10 des Fondsvertrages, dass Anlagen, Guthaben und Forderungen gemäss den vorstehenden Ziff. 3 bis 9 desselben Emittenten bzw. Schuldners 20% des Vermögens nicht übersteigen dürfen, keine Anwendung mehr.

Abschliessend wird in Ziff. 12 von § 15 des Fondsvertrages für das Teilvermögen präzisiert, dass sich der Anteil der Anlagen in einen Swisscanto-Zielfonds am Vermögen des Teilvermögens nach der Gewichtung des jeweiligen Referenzindex des Swisscanto-Zielfonds im Referenzindex des Teilvermögens bestimmt. Zudem ist diese Gewichtung in Ziff. 5.3 des Prospektes ausgewiesen (für den dort genannten Zeitpunkt).

Zusätzlich erfolgt der Hinweis, dass im Rahmen der Nachbildung des Referenzindex überdies die Gewichtung eines Swisscanto-Zielfonds (aufgrund der Berücksichtigung der Direktanlagenquote von höchstens 20% bzw. 30%) bis zu 15 Prozentpunkte von der Gewichtung des jeweiligen Referenzindex des Swisscanto-Zielfonds im Referenzindex des Teilvermögens abweichen kann.

In Zusammenhang mit der Ausgestaltung zum Dachfonds werden in § 1 Ziff. 5, § 8 Ziff. 7, 9 und Ziff. 11, § 15 Ziff. 10, Ziff. 12, 13 und Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages diverse Anpassungen vorgenommen.

2 Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible als Zielfonds

Die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible sollen neu als Zielfonds für folgende kollektive Kapitalanlagen (Dachfonds) dienen:

- Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible (im Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V).

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible soll zudem ergänzend als Zielfonds für folgende kollektive Kapitalanlage (Dachfonds) dienen:

- Swisscanto (CH) IPF I Index Equity Fund World (ex CH) Responsible (im Umbrella-Fonds der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" für qualifizierte Anleger Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund I (IPF I) mit derselben Fondsleitung und Depotbank wie die Teilvermögen im vorliegenden Umbrella-Fonds).

Diesbezüglich werden in § 8 Ziff. 7, 9 und Ziff. 11, § 15 Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages verschiedene Hinweise aufgenommen.

Vor diesem Hintergrund wird in § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible zudem neu vorgesehen, dass die Fondsleitung für das Vermögen dieses Teilvermögen bis zu 100% der Anteile der Zielfonds Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible erwerben darf (vgl. in diesem Zusammenhang auch die entsprechenden Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung betreffend die Repositionierung zum Dachfonds beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible).

Die oben aufgeführte investierende kollektive Kapitalanlage (Dachfonds), für welche die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible als Zielfonds fungieren, soll (wie bereits erwähnt) gemäss der Risikoverteilungsvorschrift jeweils bis zu 100% der Anteile des jeweiligen Zielfonds erwerben können (vgl. dazu für das Teilvermögen im vorliegenden Umbrella-Fonds die vorstehend erwähnte Anpassung von § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages). Erfolgt ein Antrag auf Rückgabe eines im Verhältnis zum Vermögen des jeweiligen Zielfonds grossen Teils der Anteile durch die investierende kollektive Kapitalanlage, ist die Fondsleitung verpflichtet zu prüfen, ob diese Rückgabe ohne jeglichen Nachteil für die verbleibenden Anleger abgewickelt werden kann. Erst dann lässt sie die betreffende Rückgabe zu. Ist die Rückgabe ohne Nachteile nicht gewährleistet, wird diese nicht zugelassen. Die Rücknahme durch den jeweiligen Zielfonds wird unverzüglich eingestellt und der betroffene Zielfonds wird fristlos aufgelöst. Die Rückzahlung wird dann im Rahmen des Auflösungsverfahrens vorgenommen. Entsprechende Hinweise bzw. Ergänzungen werden in § 15 Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages aufgenommen.

3 Umbenennung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible

Die Bezeichnung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible soll wie folgt geändert werden:

Aktuelle Bezeichnung	Neue Bezeichnung
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible	Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible

Die Bezeichnung des Teilvermögens wird im gesamten Fondsvertrag des Umbrella-Fonds entsprechend angepasst.

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags erstreckt.

Die Anlegerinnen und Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie innert 30 Tagen ab dem Zeitpunkt dieser Veröffentlichung bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern, gegen die in dieser Veröffentlichung erwähnten Änderungen des Fondsvertrags Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrags in bar verlangen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, der Jahres- und Halbjahresbericht, das Basisinformationsblatt sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 16. Januar 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich