

XAIA Credit

Halbjahresbericht zum 30. Juni 2024

Ein Investmentfonds mit Sondervermögenscharakter als Umbrellafonds
(fonds commun de placement à compartiments multiples) gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes
vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen)

R.C.S. Lux K1169



XAIA Credit

Inhalt	
Organisationsstruktur	4
Bericht des Vorstands	5
Erläuterungen zum Halbjahresabschluss zum 30. Juni 2024	6 - 10
Vermögensaufstellung	11
XAIA Credit Basis	
Vermögensübersicht	12
Vermögensaufstellung	13 - 16
Derivate	17 - 40
Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre	41 - 43
XAIA Credit Basis II	
Vermögensübersicht	44
Vermögensaufstellung	45 - 49
Derivate	50 - 84
Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre	85 - 88
XAIA Credit Debt Capital	
Vermögensübersicht	89
Vermögensaufstellung	90 - 94
Derivate	95 - 114
Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre	115 - 119

XAIA Credit

Inhalt

Anlagen	
Anlage 1: Allgemeine Angaben	120 - 122
Anlage 2: Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365	123 - 125
Anlage 3: Angaben gemäß Verordnung (EU) 2019/2088	126

Zeichnungsanträge können nicht auf der Grundlage des vorliegenden Berichtes entgegengenommen werden. Zeichnungen können nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes erfolgen.

XAIA Credit

Organisationsstruktur

Verwaltungsgesellschaft & Zentralverwaltungsstelle

Universal-Investment-Luxembourg S.A.
R.C.S. Lux B 75.014
15, rue de Flaxweiler, L - 6776 Grevenmacher

Aufsichtsrat der Verwaltungsgesellschaft

Vorsitzender des Aufsichtsrats

Frank Eggloff (bis 9. Juni 2024)
Sprecher der Geschäftsführung der
Universal-Investment-Gesellschaft mbH, D - 60486 Frankfurt am Main

Johannes Eisner (ab 11. Juni 2024)
Sprecher der Geschäftsführung der
Universal-Investment-Gesellschaft mbH, D - 60486 Frankfurt am Main

Mitglieder des Aufsichtsrats

Markus Neubauer
Geschäftsführer der
Universal-Investment-Gesellschaft mbH, D - 60486 Frankfurt am Main

Heiko Laubheimer (bis 5. Juni 2024)
Geschäftsführer der
Universal-Beteiligungs- und Servicegesellschaft mbH D - 60486 Frankfurt am Main

Katja Müller (ab 11. Juni 2024)
Geschäftsführerin der
Universal-Investment-Gesellschaft mbH, D - 60486 Frankfurt am Main

Vorstand der Verwaltungsgesellschaft

Vorsitzender des Vorstands

Etienne Rougier (bis 31. Januar 2024)

Mitglieder des Vorstands

Matthias Müller

Martin Groos

Bernhard Heinz

Verwahrstelle, Register- und Transferstelle

Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.
80, route d'Esch, L - 1470 Luxemburg

Portfoliomanager

XAIA Investment GmbH
Sonnenstraße 19, D - 80339 München

Zahlstelle

Luxemburg

Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.
80, route d'Esch, L - 1470 Luxemburg

Bundesrepublik Deutschland

Baader Bank AG
Weihenstephaner Straße 4, D - 85716 Unterschleißheim

Österreich

Erste Bank der oesterreichischen Sparkassen AG
Graben 21, A - 1010 Wien

Vertriebsstelle

Bundesrepublik Deutschland

Universal-Investment-Gesellschaft mbH
Theodor-Heuss-Allee 70, D - 60486 Frankfurt am Main

Österreich

Erste Bank der oesterreichischen Sparkassen AG
Graben 21, A - 1010 Wien

Cabinet de révision agréé

Deloitte Audit, Société à responsabilité limitée
20, Boulevard de Kockelscheuer, L - 1821 Luxemburg

XAIA Credit

Bericht des Vorstands

Sehr geehrte Damen und Herren,

wir legen Ihnen hiermit den Halbjahresbericht des XAIA Credit mit seinen Teilfonds XAIA Credit Basis, XAIA Credit Basis II und XAIA Credit Debt Capital vor. Der Bericht umfasst den Zeitraum vom 1. Januar 2024 bis zum 30. Juni 2024.

Der XAIA Credit ist ein nach dem Recht des Großherzogtums Luxemburg auf unbestimmte Dauer errichtetes, rechtlich unselbstständiges Sondervermögen („fonds commun de placement à compartiments multiples“) und unterliegt dem Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über die Organismen für gemeinsame Anlagen.

Vor dem Erwerb von Anteilen werden dem Anleger kostenlos die wesentlichen Anlegerinformationen ("Key Investor Information Document(s)"/ "KIID (s)") zur Verfügung gestellt. Der Fonds bietet den Anlegern die Möglichkeit, in eine Investmentgesellschaft nach luxemburgischem Recht zu investieren.

Frank Eggloff schied zum 9. Juni 2024 aus dem Aufsichtsrat der Verwaltungsgesellschaft aus. Neuer Vorsitzender des Aufsichtsrats der Verwaltungsgesellschaft ist seit 11. Juni 2024 Johannes Elsner. Heiko Laubheimer schied zum 5. Juni 2024 aus dem Aufsichtsrat der Verwaltungsgesellschaft aus. Ab 11. Juni 2024 ist Katja Müller ein neues Mitglied des Aufsichtsrats der Verwaltungsgesellschaft.

Bis zum 31. Januar 2024 war Etienne Rougier Vorsitzender des Vorstands der Verwaltungsgesellschaft.

Zum 30. Juni 2024 stellen sich das Fondsvermögen sowie die Kursentwicklung des Fonds im Berichtszeitraum wie folgt dar:

Anteilklasse	ISIN	Fondsvermögen in EUR	Kursentwicklung in % *)
XAIA Credit Basis (I)	LU0418282934	188,877,214.12	3.49
XAIA Credit Basis (G)	LU0418282348	39,744.29	0.17
XAIA Credit Basis (IT)	LU0946790523	21,574,315.02	3.49
XAIA Credit Basis II (I)	LU0462885301	276,493,194.54	3.17
XAIA Credit Basis II (P)	LU0462885483	5,670,661.01	2.83
XAIA Credit Basis II (IT)	LU0946790796	208,023,171.87	3.17
XAIA Credit Basis II (R)	LU2194006594	16,658,148.91	3.06
XAIA Credit Debt Capital (I)	LU0644384843	60,048,102.28	2.45
XAIA Credit Debt Capital (P)	LU0644385733	6,265,076.73	2.18
XAIA Credit Debt Capital (V)	LU0880249403	11,821,642.80	2.44
XAIA Credit Debt Capital (IT)	LU0946790952	170,306,387.58	2.46
XAIA Credit Debt Capital (R)	LU2194006164	16,436,726.81	2.41

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist keine Garantie für die künftige Entwicklung.

Erläuterungen zum Halbjahresabschluss zum 30. Juni 2024

Allgemeines

Der XAIA Credit ist ein nach dem Recht des Großherzogtums Luxemburg auf unbestimmte Dauer errichtetes, rechtlich unselbstständiges Sondervermögen („fonds commun de placement à compartiments multiples“) und unterliegt dem Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über die Organismen für gemeinsame Anlagen.

Ziel der Teilfonds ist es, eine deutliche Überrendite zum 3-Monats-Euribor (Euro Interbank Offered Rate) zu erwirtschaften. Das Geschäftsjahr beginnt am 1. Januar und endet am 31. Dezember. Der Sitz des Fonds ist Grevenmacher im Großherzogtum Luxemburg.

Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze

Der Halbjahresabschluss wurde in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Halbjahresabschlusses sowie unter Annahme der Unternehmensfortführung aufgestellt.

Der Anteilwert des jeweiligen Teilfonds/der Anteilklasse wird in der jeweiligen Referenzwährung in Übereinstimmung mit den Bestimmungen von Artikel 9 des Verwaltungsreglements berechnet. Die Berichtswährung ist der Euro. Der Anteilwert des jeweiligen Teilfonds wird an jedem ganzen Bankarbeitstag, der gleichzeitig ein Börsentag in Frankfurt am Main, München und Luxemburg („Bewertungstag“) ist, berechnet, sofern im Anhang für den jeweiligen Teilfonds keine anderweitige Regelung getroffen wird. Zur Berechnung des Anteilwerts wird der Wert der zu einem Teilfonds/zur Anteilklasse gehörenden Vermögenswerte abzüglich der Verbindlichkeiten des Fonds/ der Anteilklasse an jedem Bewertungstag ermittelt („Teilfondsvermögen“) und durch die Anzahl der am Bewertungstag im Umlauf befindlichen Anteile des Teilfonds/der Anteilklasse geteilt und auf zwei Dezimalstellen gerundet.

Das jeweilige Teilfondsvermögen wird nach folgenden Grundsätzen berechnet:

- a) Vermögenswerte, die an einer Börse amtlich notiert sind, werden zum letzten verfügbaren Kurs bewertet. Wenn ein Vermögenswert an mehreren Börsen notiert ist, ist der letzte verfügbare Kurs an jener Börse maßgebend, die der Hauptmarkt für diesen Vermögenswert ist.
- b) Vermögenswerte, die nicht an einer Börse notiert sind, die aber an einem anderen geregelten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt gehandelt werden, werden zu dem Kurs bewertet, der nicht geringer als der Geldkurs und nicht höher als der Briefkurs zur Zeit der Bewertung sein darf und den die Verwaltungsgesellschaft für den bestmöglichen Kurs hält, zu dem die Vermögenswerte verkauft werden können.
- c) Nicht börsennotierte Derivate werden auf einer von der Verwaltungsgesellschaft festzulegenden und überprüfaren Bewertung auf Tagesbasis bewertet. Die für die Preisfeststellung der Derivate bestimmten Kriterien erfolgen in üblicher, vom Wirtschaftsprüfer nachvollziehbarer Weise.
- d) Falls die unter vorstehend a) und b) genannten Kurse nicht marktgerecht sind oder sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder auf einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für Vermögenswerte, welche an einer Börse oder auf einem anderen Markt wie vorerwähnt notiert oder gehandelt werden, die Kurse entsprechend den Regelungen in a) oder b) den tatsächlichen Marktwert der entsprechenden Vermögenswerte nicht angemessen widerspiegeln, werden diese Vermögenswerte ebenso wie alle anderen Vermögenswerte zum jeweiligen Verkehrswert bewertet, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben und allgemein anerkannten von Wirtschaftsprüfern nachprüfaren Bewertungsregeln festlegt.
- e) Die auf Vermögenswerte entfallenden anteiligen Zinsen werden mit einbezogen, soweit sie sich nicht im Kurswert ausdrücken.
- f) Der Liquidationswert von Forwards oder Optionen, die nicht an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, wird gemäß den Richtlinien der Verwaltungsgesellschaft auf einer konsistent für alle verschiedenen Arten von Verträgen angewandten Grundlage festgestellt. Der Liquidationswert von Futures oder Optionen, welche an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, wird auf der Grundlage der letzten verfügbaren Abwicklungspreise solcher Verträge an den Börsen oder organisierten Märkten, auf welchen diese Futures oder Optionen vom Fonds gehandelt werden, berechnet; sofern ein Future, Forward oder eine Option an einem Tag, für welchen der Nettoinventarwert bestimmt wird, nicht liquidiert werden kann, wird die Bewertungsgrundlage für einen solchen Vertrag von der Geschäftsführung in angemessener und vernünftiger Weise bestimmt.
- g) Swaps werden zum Barwert (Present Value) bewertet.
- h) Flüssige Mittel werden zu deren Nennwert zzgl. anteiliger Zinsen bewertet. Festgelder können zum jeweiligen Renditekurs bewertet werden, vorausgesetzt, ein entsprechender Vertrag zwischen dem Finanzinstitut, welches die Festgelder verwahrt, und der Verwaltungsgesellschaft sieht vor, dass diese Festgelder zu jeder Zeit kündbar sind und dass im Falle einer Kündigung ihr Realisierungswert diesem Renditekurs entspricht.
- i) Zielfondsanteile werden zum letzten festgestellten und erhältlichen Nettoinventarwert bewertet. Falls für Investmentanteile die Rücknahme ausgesetzt ist oder keine Rücknahmepreise festgelegt werden, werden die Anteile ebenso wie alle anderen Vermögenswerte zum jeweiligen Verkehrswert bewertet, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben auf der Grundlage des wahrscheinlich erchenbaren Veräußerungswertes festlegt.
- j) Alle nicht auf die Fondswährung lautenden Vermögenswerte werden zum letzten verfügbaren Devisenkurs in die betreffende Fondswährung umgerechnet. Gewinne oder Verluste aus Devisentransaktionen werden hinzugerechnet oder abgesetzt.
- k) Sämtliche sonstigen Wertpapiere oder sonstigen Vermögenswerte werden zu ihrem angemessenen Verkehrswert bewertet, wie dieser nach Treu und Glauben von der Verwaltungsgesellschaft und nach einem von ihr festgelegten Verfahren bestimmt wird.

Erläuterungen zum Halbjahresabschluss zum 30. Juni 2024

Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

Die Verwaltungsgesellschaft kann nach eigenem Ermessen andere Bewertungsmethoden zulassen, wenn sie dieses im Interesse einer angemesseneren Bewertung eines Vermögenswertes des Fonds für angebracht hält.

Wenn die Verwaltungsgesellschaft der Ansicht ist, dass der ermittelte Nettoinventarwert an einem bestimmten Bewertungstag den tatsächlichen Wert der Anteile des Teilfonds nicht wiedergibt, oder wenn es seit der Ermittlung des Nettoinventarwertes beträchtliche Bewegungen an den betreffenden Börsen und/oder Märkten gegeben hat, kann die Verwaltungsgesellschaft beschließen, den Nettoinventarwert noch am selben Tag zu aktualisieren. Unter diesen Umständen werden alle für diesen Bewertungstag eingegangenen Anträge auf Zeichnung und Rücknahme auf der Grundlage des Nettoinventarwertes eingelöst, der unter Berücksichtigung des Grundsatzes von Treu und Glauben aktualisiert worden ist.

Das jeweilige Teilfondsvermögen wird gegebenenfalls um Ausschüttungen reduziert, die an die Anleger des jeweiligen Teilfonds gezahlt werden.

Im Falle von Anteilklassen erfolgt die daraus resultierende Anteilwertberechnung nach den vorstehend aufgeführten Kriterien für jede Anteilklasse getrennt. Die Zusammenstellung und Zuordnung der Aktiva erfolgt jedoch immer für den gesamten Teilfonds.

Realisierte Gewinne/Verluste aus Wertpapierverkäufen

Die auf den Verkäufen von Wertpapieren realisierten Gewinne oder Verluste werden auf der Basis des durchschnittlichen Einstandspreises der verkauften Wertpapiere berechnet.

Bewertung von Optionen

Die Bewertung der zum offiziellen Handel oder zu einem beliebigen anderen organisierten Markt zugelassenen Optionen erfolgt auf der Grundlage des letzten bekannten Kurses. Nicht notierte oder nicht an einer Börse oder einem beliebigen anderen organisierten Markt gehandelte Optionen werden auf der Grundlage des wahrscheinlichen Verkaufswertes bewertet, der nach bestem Wissen geschätzt wird.

Bewertung von Termingeschäften

Die Gewinne bzw. Verluste aus offenen Termingeschäften werden auf der Grundlage der am Bilanzstichtag verfügbaren Tagesschlusskurse bestimmt und in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Nettovermögens ausgewiesen.

Bewertung von Devisentermingeschäften

Der nicht realisierte Gewinn/Verlust der ausstehenden Devisentermingeschäfte wird am Bewertungstag zum Terminwechsellkurs berechnet und gebucht.

Devisenkurse

Per 30. Juni 2024 wurden die Bewertungen der Fremdwährungspositionen unter Verwendung der nachstehenden Devisenkurse in die Fondswährung umgerechnet:

Währung	Kurs
EUR - CHF	0.9627
EUR - GBP	0.8476
EUR - JPY	172.3561
EUR - USD	1.0716
EUR - ZAR	19.5637

XAIA Credit

Erläuterungen zum Halbjahresabschluss zum 30. Juni 2024

Verwaltungsvergütung

Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Teilfondsvermögens ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer. Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Fondsvermögen eine jährliche Vergütung in Höhe von:

XAIA Credit Basis (I)	0,60% p.a.	Ein darüber hinausgehendes erfolgsbezogenes Entgelt wird nicht erhoben.
XAIA Credit Basis (G)	1,10% p.a.	Ein darüber hinausgehendes erfolgsbezogenes Entgelt wird nicht erhoben.
XAIA Credit Basis (IT)	0,60% p.a.	Ein darüber hinausgehendes erfolgsbezogenes Entgelt wird nicht erhoben.
XAIA Credit Basis II (I)	0,80% p.a.	
XAIA Credit Basis II (P)	1,30% p.a.	
XAIA Credit Basis II (IT)	0,80% p.a.	
XAIA Credit Basis II (R)	0,80% p.a.	
XAIA Credit Debt Capital (I)	0,50% p.a.	
XAIA Credit Debt Capital (P)	1,00% p.a.	
XAIA Credit Debt Capital (V)	0,50% p.a.	
XAIA Credit Debt Capital (IT)	0,50% p.a.	
XAIA Credit Debt Capital (R)	0,50% p.a.	

Performance Fee

Für alle Anteilklassen des XAIA Credit Basis

Keine

Für alle Anteilklassen des XAIA Credit Basis II

Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Teilfondsvermögen eine wertentwicklungsabhängige Vergütung (Performance Fee) von 15% der Mehr-Performance über einen sog. Hurdle-Index. Die Performance Fee wird bewertungstäglich berechnet und zum Geschäftsjahresende ausbezahlt. Bei Auflegung des Fonds liegt der Hurdle-Index auf dem Erstausgabepreis des Fonds und entwickelt sich im Laufe des Geschäftsjahres auf Basis des 3-Monats-Euribor +2,00%, korrigiert um vom Fonds gezahlte Ausschüttungen oder Abschlagssteuern pro Anteil. Der 3-Monats-Euribor (Euro Interbank Offered Rate) ist der Zinssatz für in Euro denominatedes Termingeld im Interbankengeschäft zwischen Banken hoher Bonität. Der Zinssatz wird jeweils im März, Juni, September und Dezember so festgesetzt, dass er marktüblich zu den sogenannten IMM-Daten *) valutarisch Anwendung findet, also 2 Bankarbeitstage vor diesen IMM-Tagen. Der erste Zinssatz wird am Auflegungstag als interpolierter Euriborsatz für die Laufzeit bis zum nächsten IMM-Datum errechnet.

Nach Abschluss eines Geschäftsjahres wird der Hurdle-Index zum Geschäftsjahresende auf den höheren Wert von a) dem für das Geschäftsende errechneten Hurdle-Index-Wert und b) dem Anteilwert des Fonds nach Auszahlung der Performance Fee für das abgelaufene Geschäftsjahr (High Water Mark) angepasst.

Um Verwässerungseffekte zu vermeiden, wird bei Anteilrückgaben die Performance Fee für die zurückgegebenen Anteile, soweit positiv, aus dem Fondsvolumen zurückgestellt und am Jahresende ausbezahlt. Dazu wird zur Berechnung dieser Rückstellungen die ggf. errechnete und abgegrenzte Performance Fee pro Anteil (ohne Berücksichtigung der Korrekturposten für Rückgaben und Zuflüsse) mit den zurückgenommenen Anteilen multipliziert. Bei Zeichnungen wird die ggf. errechnete und abgegrenzte Performance Fee pro Anteil (ohne Berücksichtigung der Korrekturposten für Rückgaben und Zuflüsse) multipliziert mit den zugeflossenen Anteilen, dem Fonds als positiver Korrekturposten angerechnet. Die Performance Fee ergibt sich aus dem Maximum aus Wert 1 und Wert 2 zuzüglich der aufgrund von Rückgaben gebildeten Rückstellungen. Dabei ist Wert 1 definiert als Null. Wert 2 ergibt sich als Differenz des Anteilswertes (vor Performance Fee) und dem Hurdle-Index, multipliziert mit der Anzahl der aktuell umlaufenden Anteile und einem Faktor von 15% abzüglich der Korrekturposten für Zuflüsse.

Am Geschäftsjahresende wird nach Auszahlung der so errechneten Performance Fee der Hurdle-Index wie beschrieben angepasst und die Rückstellungen und Korrekturposten auf null zurückgesetzt, unabhängig davon, ob eine Performance Fee ausbezahlt wurde oder nicht.

Für den Teilfonds XAIA Credit Basis II ist im abgelaufenen Geschäftsjahr keine Performance Fee angefallen.

*) IMM Daten sind jeweils der dritte Mittwoch der Monate März, Juni, September und Dezember, adjustiert um Feiertagsregelungen, die die Zinsperioden definieren, auf die die standardisierten Euribor-Kontrakte verschiedener Terminbörsen referenzieren. Die Abkürzung IMM steht für „International Monetary Market“.

XAIA Credit

Erläuterungen zum Halbjahresabschluss zum 30. Juni 2024

Performance Fee (Fortsetzung)

Für alle Anteilklassen des XAIA Credit Debt Capital

Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Teilfondsvermögen eine wertentwicklungsabhängige Vergütung (Performance Fee) von 20% der Mehrperformance über einen sog. Hurdle-Index. Die Performance Fee wird bewertungstäglich berechnet und zum Geschäftsjahresende ausbezahlt. Bei Auflegung des Fonds liegt der Hurdle-Index auf dem Erstausgabepreis des Fonds und entwickelt sich im Laufe des Geschäftsjahres auf Basis des 3-Monats-Euribor, korrigiert um vom Fonds gezahlte Ausschüttungen oder Abschlagssteuern pro Anteil. Der 3-Monats Euribor (Euro Interbank Offered Rate) ist der Zinssatz für in Euro denominiertes Termingeld im Interbankengeschäft zwischen Banken hoher Bonität. Der Zinssatz wird jeweils im März, Juni, September und Dezember so festgesetzt, dass er marktüblich zu den sogenannten IMM-Daten *) valutarisch Anwendung findet, also 2 Bankarbeitstage vor diesen IMM-Tagen. Der erste Zinssatz wird am Auflegungstag als interpolierter Euriborsatz für die Laufzeit bis zum nächsten IMM-Datum errechnet.

Nach Abschluss eines Geschäftsjahres wird der Hurdle-Index zum Geschäftsjahresende auf den höheren Wert von a) dem für das Geschäftsjahresende errechneten Hurdle-Index-Wert und b) dem Anteilwert des Fonds nach Auszahlung der Performance Fee für das abgelaufene Geschäftsjahr (High Water Mark) angepasst.

Um Verwässerungseffekte zu vermeiden, wird bei Anteilrückgaben die Performance Fee für die zurückgegebenen Anteile, soweit positiv, aus dem Fondsvolumen zurückgestellt und am Jahresende ausbezahlt. Dazu wird zur Berechnung dieser Rückstellungen die ggf. errechnete und abgegrenzte Performance Fee pro Anteil (ohne Berücksichtigung der Korrekturposten für Rückgaben und Zuflüsse) mit den zurückgenommenen Anteilen multipliziert. Bei Zeichnungen wird die ggf. errechnete und abgegrenzte Performance Fee pro Anteil (ohne Berücksichtigung der Korrekturposten für Rückgaben und Zuflüsse) multipliziert mit den zugeflossenen Anteilen, dem Fonds als positiver Korrekturposten angerechnet. Die Performance Fee ergibt sich aus dem Maximum aus Wert 1 und Wert 2 zuzüglich der aufgrund von Rückgaben gebildeten Rückstellungen. Dabei ist Wert 1 definiert als Null. Wert 2 ergibt sich als Differenz des Anteilswertes (vor Performance Fee) und dem Hurdle-Index, multipliziert mit der Anzahl der aktuell umlaufenden Anteile und einem Faktor von 20% abzüglich der Korrekturposten für Zuflüsse.

Am Geschäftsjahresende wird nach Auszahlung der so errechneten Performance Fee der Hurdle-Index wie beschrieben angepasst und die Rückstellungen und Korrekturposten auf null zurückgesetzt, unabhängig davon, ob eine Performance Fee ausbezahlt wurde oder nicht.

*) IMM Daten sind jeweils der dritte Mittwoch der Monate März, Juni, September und Dezember, adjustiert um Feiertagsregelungen, die die Zinsperioden definieren, auf die die standardisierten Euribor-Kontrakte verschiedener Terminbörsen referenzieren. Die Abkürzung IMM steht für „International Monetary Market“.

Teilfonds	Performance Fee in %	Tatsächlich erhobene Performance Fee in EUR
XAIA Credit Debt Capital (I)	0.12	62,308.60
XAIA Credit Debt Capital (P)	0.03	1,509.14
XAIA Credit Debt Capital (V)	0.15	23,938.03
XAIA Credit Debt Capital (IT)	0.13	225,826.74
XAIA Credit Debt Capital (R)	0.03	3,077.28

Verwahrstelle-, Registerstellen- und Transfer- sowie Zahlstellenvergütung

Die Verwahrstelle, die Register- und Transferstelle und die Zahlstelle in Luxemburg sind berechtigt, insgesamt ein Entgelt von bis zu 0,05% p.a., mindestens jedoch EUR 80.400,00 p.a. je Teilfonds zu erhalten. Diese Vergütung wird täglich abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen Teilfondsvermögens berechnet und ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

XAIA Credit

Erläuterungen zum Halbjahresabschluss zum 30. Juni 2024

Transaktionskosten

Für den am 30. Juni 2024 endenden Berichtszeitraum sind für den XAIA Credit im Zusammenhang mit dem Kauf und Verkauf von Wertpapieren, Geldmarktpapieren, Derivaten oder anderen Vermögensgegenständen folgende Transaktionskosten angefallen:

Teilfonds	Transaktionskosten in EUR
XAIA Credit Basis	12,749.50
XAIA Credit Basis II	18,147.23
XAIA Credit Debt Capital	35,193.31

Zu den Transaktionskosten zählen insbesondere Provisionen für Broker und Makler, Clearinggebühren und fremde Entgelte (z. B. Börsenentgelte, lokale Steuern und Gebühren, Registrierungs- und Umschreibgebühren).

Sonstige Kosten

Kosten einzelner Teilfonds, soweit sie diese gesondert betreffen, werden diesen angerechnet, ansonsten werden die Kosten, welche den gesamten Fonds betreffen, den einzelnen Teilfonds gleichmäßig belastet. Der Fonds bildet eine rechtliche Einheit. Dritten gegenüber sowie in den Beziehungen der Anteilinhaber untereinander wird jeder Teilfonds als eigenständige Einheit behandelt. Jeder Teilfonds haftet in diesem Sinne ausschließlich für seine eigenen Verbindlichkeiten, die diesem in der Nettovermögensberechnung zugewiesen werden.

Besteuerung

Das Teilfondsvermögen unterliegt im Großherzogtum Luxemburg einer Steuer („taxe d'abonnement“) von zur Zeit 0,05% p.a. In Bezug auf Teilfonds bzw. Anteilklassen, die institutionellen Investoren vorbehalten sind, beträgt die taxe d'abonnement 0,01% p.a. Diese taxe d'abonnement ist vierteljährlich auf das jeweils am Quartalsende ausgewiesene Teilfondsvermögen zahlbar. Die Einkünfte des Fonds werden in Luxemburg nicht besteuert. Allerdings können diese Einkünfte in Ländern, in denen Vermögenswerte des Fonds angelegt sind, der Quellenbesteuerung unterworfen werden. In solchen Fällen sind weder Verwahrstelle noch Verwaltungsgesellschaft zur Einholung von Steuerbescheinigungen verpflichtet.

Interessenten sollten sich über Gesetze und Verordnungen, die für den Erwerb, den Besitz und die Rücknahme von Anteilen Anwendung finden, informieren und, falls angebracht, beraten lassen.

Veröffentlichungen

Die Ausgabe- und Rücknahmepreise sind jeweils am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, der Verwahrstelle und der Zahlstellen des Fonds im Ausland zur Information verfügbar und werden gemäß den gesetzlichen Bestimmungen eines jeden Landes, in dem die Anteile zum öffentlichen Vertrieb berechtigt sind sowie auf der Internetseite der Verwaltungsgesellschaft (www.universal-investment.com), veröffentlicht. Der Inventarwert kann am Sitz der Verwaltungsgesellschaft angefragt werden und wird ebenfalls auf der Internetseite der Verwaltungsgesellschaft veröffentlicht.

Informationen, insbesondere Mitteilungen an die Anleger, werden auf der Internetseite der Verwaltungsgesellschaft veröffentlicht. Darüber hinaus werden in gesetzlich vorgeschriebenen Fällen für das Großherzogtum Luxemburg Mitteilungen auch im RESA und in einer luxemburger Tageszeitung sowie falls erforderlich, in einer weiteren Tageszeitung mit hinreichender Auflage, publiziert.

Veränderungen im Wertpapierbestand

Die Veränderung des Wertpapierbestandes im Berichtszeitraum ist kostenlos am Geschäftssitz der Verwaltungsgesellschaft, über die Verwahrstelle sowie über jede Zahlstelle erhältlich.

XAIA Credit

Die Vermögensaufstellung setzt sich aus der Summe aller Teilfonds zusammen.

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

	Kurswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen *)
Aktiva		
Wertpapiervermögen	838,525,801.54	85.37
Derivate	-6,485,085.51	-0.66
Bankguthaben	142,130,059.04	14.47
Zinsansprüche	9,681,576.78	0.99
Zinsansprüche Swaps	11,086,200.02	1.13
Forderung aus Wertpapier-Pensionsgeschäft	21,078.00	1.18
Sonstige Forderungen	19,849.77	0.00
Gesamtaktiva	994,979,479.64	101.30
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme	-1,507,922.49	-0.15
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	-10,092,700.88	-1.03
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsvergütung	-530,614.74	-0.05
Verbindlichkeiten aus Performance Fee	-310,220.15	-0.03
Verbindlichkeiten aus Verwahrstellenvergütung	-36,089.87	-0.00
Verbindlichkeiten aus Depotgebühren	-126,629.13	-0.01
Rückstellungen für Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	-107,600.01	-0.01
Taxe d'abonnement	-28,409.99	-0.00
Sonstige Verbindlichkeiten	-24,906.43	-0.00
Gesamtpassiva	-12,765,093.69	-1.30
Fondsvermögen	982,214,385.95	100.00

*) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

XAIA Credit Basis

Vermögensübersicht zum 30.06.2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Teilfondsvermögen *)
I. Vermögensgegenstände	214,045,236.73	101.69
1. Anleihen	187,897,949.82	89.27
2. Derivate	-246,342.78	-0.12
3. Bankguthaben	22,003,654.82	10.45
4. Sonstige Vermögensgegenstände	4,389,974.87	2.09
II. Verbindlichkeiten	-3,553,963.30	-1.69
III. Teilfondsvermögen	210,491,273.43	100.00

*) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

XAIA Credit Basis

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2024	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens *)
Bestandspositionen				EUR		187,897,949.82	89.27
Börsengehandelte Wertpapiere				EUR		31,643,797.35	15.03
Verzinsliche Wertpapiere				EUR		31,643,797.35	15.03
0,7500 % Dufry One B.V. SF-Conv. Bonds 2021(26)	CH1105195684	%	1,800	CHF	96.239	1,799,429.50	0.85
1,0000 % Teva Pharmac.Fin.NL IV B.V. SF-Schuldversch. 2016(25)	CH0333827506	%	1,675	CHF	97.875	1,702,920.89	0.81
6,5140 % Commerzbank AG Sub.Fix to Float.MTN v.17(29)	XS1571152781	%	2,000	EUR	94.944	1,898,884.54	0.90
5,0000 % SoftBank Group Corp. EO-Notes 2018(18/28)	XS1793255941	%	7,450	EUR	98.895	7,367,654.07	3.50
3,0000 % HSBC Holdings PLC LS-FLR Notes 2019(29/30)	XS2003500142	%	2,500	GBP	89.977	2,653,890.14	1.26
7,6000 % Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2007(07/37)	US532716AN75	%	3,000	USD	95.895	2,684,622.21	1.28
4,7550 % HSBC Holdings PLC DL-FLR Notes 2022(22/28)	US404280DF39	%	3,000	USD	98.289	2,751,651.49	1.31
7,4500 % Safeway Inc. DL-Debts. 1997(97/27)	US786514AS84	%	4,042	USD	103.282	3,895,731.49	1.85
2,6080 % Standard Chartered PLC DL-FLR Notes 2022(27/28) 144A	US853254CG39	%	500	USD	92.798	432,986.00	0.21
7,7670 % Standard Chartered PLC DL-FLR Notes 2022(27/28) 144A	US853254CN89	%	6,500	USD	106.435	6,456,027.02	3.07
An regulierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				EUR		120,043,306.04	57.03
Verzinsliche Wertpapiere				EUR		120,043,306.04	57.03
9,5780 % Stonegate Pub Comp.Fin.19 PLC EO-FLR Notes 2020(20/25) Reg.S	XS2210013970	%	3,000	EUR	98.237	2,947,104.27	1.40
4,5000 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. EO-Notes 2018(18/25)	XS1813724603	%	4,144	EUR	99.795	4,135,490.41	1.96
3,7500 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. EO-Notes 2021(21/27)	XS2406607098	%	2,380	EUR	97.375	2,317,529.06	1.10
6,6250 % TK Elevator Holdco GmbH Anleihe v.20(20/28) Reg.S	XS2198191962	%	2,400	EUR	96.148	2,076,803.35	0.99
6,6250 % Amkor Technology Inc. DL-Notes 2019(19/27) 144A	US031652BK50	%	1,600	USD	100.025	1,493,468.21	0.71
4,7500 % Boyd Gaming Corp. DL-Notes 2020(20/27)	US103304BU40	%	4,250	USD	96.164	3,813,885.34	1.81
9,0000 % Cloud Software Group Inc. DL-Notes 2023(23/29) 144A	US18912UAA07	%	3,000	USD	96.631	2,705,247.27	1.29
4,6250 % DaVita Inc. DL-Notes 2020(20/30) 144A	US23918KAS78	%	1,650	USD	90.603	1,395,056.58	0.66
8,2480 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-FLR Pref.MTN 22(32/33) 144A	US46115HBV87	%	8,000	USD	110.741	8,267,360.71	3.93
8,2480 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-FLR Pref.MTN 22(32/33)Reg.S	XS2559133363	%	9,500	USD	110.735	9,816,922.83	4.66
6,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-Notes 2023(33) 144A X	US46115HBZ91	%	10,250	USD	103.681	9,917,232.89	4.71
4,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-Receipts 2019(29) Cl.X 144A	US46115HBL06	%	8,100	USD	92.249	6,972,900.53	3.31
4,8750 % Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	US46284VAC54	%	3,500	USD	96.558	3,153,717.55	1.50
5,0000 % Iron Mountain Inc. DL-Notes 2020(20/28) 144A	US46284VAG68	%	2,755	USD	95.589	2,457,513.43	1.17
3,6250 % Louisiana Pacific Corp. DL-Notes 2021(21/29) 144A	US546347AM73	%	3,350	USD	90.789	2,838,213.03	1.35
5,2500 % MGIC Investment Corp. DL-Notes 2020(20/28)	US552848AG81	%	3,936	USD	96.954	3,561,135.81	1.69
4,3450 % Nissan Motor Co. Ltd. DL-Notes 2020(20/27) 144A	US654744AC50	%	2,628	USD	95.562	2,343,568.40	1.11
4,8100 % Nissan Motor Co. Ltd. DL-Notes 2020(20/30) 144A	US654744AD34	%	3,000	USD	93.098	2,606,325.92	1.24

XAIA Credit Basis

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2024	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens *)
4,8100 % Nissan Motor Co. Ltd. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USJ57160DZ32	%	11,400	USD	93.082	9,902,316.42	4.70
9,5000 % Olin Corp. DL-Notes 2020(20/25) 144A	US680665AM82	%	7,200	USD	102.028	6,855,214.57	3.26
8,3750 % Pactiv LLC DL-Debts 1999(99/27)	US880394AE11	%	1,500	USD	103.355	1,446,734.46	0.69
7,9500 % Pactiv LLC DL-Notes 1999(25)	US880394AB71	%	3,388	USD	101.783	3,217,997.92	1.53
1,4880 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 20(25/26) 144A	US83368RAZ55	%	6,507	USD	93.615	5,684,519.92	2.70
1,4880 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 20(25/26)Reg.S	US83368TAZ12	%	9,000	USD	93.615	7,862,406.52	3.74
2,7970 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 22(27/28)Reg.S	US83368TBH05	%	2,500	USD	92.518	2,158,412.38	1.03
6,4460 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 23(28/29) 144A	US83368RBR21	%	3,000	USD	101.552	2,843,003.08	1.35
7,4500 % Transocean Inc. DL-Notes 1997(97/27)	US893817AA41	%	1,975	USD	96.506	1,778,642.83	0.84
5,0000 % UBS AG DL-FLR Med.-Term Nts 2016(26)	US22548Q3E34	%	1,500	USD	99.231	1,389,015.69	0.66
1,9820 % UniCredit S.p.A. DL-FLR Pref. MTN 2021(26/27)	XS2348710562	%	1,500	USD	93.236	1,305,093.35	0.62
3,1270 % UniCredit S.p.A. DL-FLR Pref. MTN 2021(31/32)	XS2348714713	%	3,500	USD	85.130	2,780,473.31	1.32
Nichtnotierte Wertpapiere				EUR		36,210,846.43	17.20
Verzinsliche Wertpapiere				EUR		36,210,846.43	17.20
0,0000 % Banco Espirito Santo S.A. EO-Medium-Term Notes 2011(16)	PTBEQBOM0010	%	3,000	EUR	29.012	870,353.94	0.41
0,0000 % Galapagos Holding S.A. EO-Notes 2014(17/22) Reg.S	XS1071420027	%	100	EUR	0.000	0.00	0.00
4,2000 % Banque Centrale de Tunisie YN-Bonds 2001(31)	XS0126471233	%	200,000	JPY	61.824	717,398.79	0.34
3,2800 % Banque Centrale de Tunisie YN-Bonds 2007(27) No.7	JP578801A785	%	1,100,000	JPY	72.829	4,648,062.97	2.21
0,8000 % Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2021(28) No. 17	JP396720CMC6	%	1,100,000	JPY	83.474	5,327,427.35	2.53
1,0500 % Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2021(31) No. 18	JP396720DMC4	%	300,000	JPY	71.658	1,247,266.30	0.59
7,5000 % Alb.Cos LLC/Safe.Inc/N.A.I./A. DL-Notes 2019(19/26) 144A	US013092AA91	%	4,000	USD	101.211	3,777,955.68	1.79
2,7180 % Sodexo Inc. DL-Bonds 2021(21/31)	US833794AB68	%	3,900	USD	85.151	3,099,013.21	1.47
1,9820 % UniCredit S.p.A. DL-FLR Pref. MTN 2021(26/27)	US904678AW97	%	4,395	USD	93.236	3,823,923.51	1.82
3,1270 % UniCredit S.p.A. DL-FLR Pref. MTN 2021(31/32)	US904678AY53	%	12,536	USD	85.110	9,956,493.50	4.73
6,8750 % Unisys Corp. DL-Notes 2020(20/27) 144A	US909214BV97	%	3,350	USD	87.742	2,742,951.18	1.30
Summe Wertpapiervermögen				EUR		187,897,949.82	89.27
Derivate				EUR		-246,342.78	-0.12

XAIA Credit Basis

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2024	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens *)
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds				EUR		22,003,654.82	10.45
Bankguthaben				EUR		22,003,654.82	10.45
Guthaben bei Skandinaviska Enskilda Banken AB Stockholm Tagesgeld			2,980.76	CHF		3,096.25	0.00
Guthaben bei Bayerische Landesbank München Tagesgeld			17,000,000.00	EUR		17,000,000.00	8.08
Guthaben bei HSBC Continental Europe S.A. - Paris Tagesgeld			637,725.90	EUR		637,725.90	0.30
Guthaben bei Landesbank Baden-Württemberg Stuttgart Tagesgeld			4,000,000.00	EUR		4,000,000.00	1.90
Guthaben bei SUMITOMO MITSUI TRUST BANK Ltd. GB Tagesgeld			2,142.02 5,974,581.00	GBP JPY		2,527.16 34,664.17	0.00 0.02
Guthaben bei DBS Group Holdings Ltd., Singapore Tagesgeld			348,957.26	USD		325,641.34	0.15
Sonstige Vermögensgegenstände				EUR		4,389,974.87	2.09
Zinsansprüche			1,932,223.15	EUR		1,932,223.15	0.92
Zinsansprüche Swaps			2,447,212.72	EUR		2,447,212.72	1.16
Forderung aus Wertpapier-Pensionsgeschäft			10,539.00	EUR		10,539.00	0.01
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme				EUR		-1,288,213.56	-0.61
Kredite bei Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.							
EUR - Kredite (Cash Collateral)			-1,250,000.00	EUR		-1,250,000.00	-0.59
EUR - Kredite			-38,213.56	EUR		-38,213.56	-0.02

XAIA Credit Basis

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2024	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens *)
Verbindlichkeiten				EUR		-2,265,749.74	-1.07
Zinsverbindlichkeiten Swaps			-2,082,406.25	EUR		-2,082,406.25	-0.99
Verwaltungsvergütung			-100,207.45	EUR		-100,207.45	-0.05
Verwahrstellenvergütung			-7,741.00	EUR		-7,741.00	0.00
Depotgebühren			-27,161.00	EUR		-27,161.00	-0.01
Prüfungs- und Veröffentlichungskosten			-33,625.00	EUR		-33,625.00	-0.02
Taxe d'abonnement			-5,148.31	EUR		-5,148.31	0.00
Sonstige Verbindlichkeiten			-9,460.73	EUR		-9,460.73	0.00
Teilfondsvermögen				EUR		210,491,273.43	100.00
XAIA Credit Basis (I)							
Anteilwert				EUR		1,122.95	
Ausgabepreis				EUR		1,122.95	
Rücknahmepreis				EUR		1,122.95	
Anteile im Umlauf				STK		168,196.993	
XAIA Credit Basis (G)							
Anteilwert				EUR		1,019.08	
Ausgabepreis				EUR		1,039.46	
Rücknahmepreis				EUR		1,019.08	
Anteile im Umlauf				STK		39.000	
XAIA Credit Basis (IT)							
Anteilwert				EUR		1,249.83	
Ausgabepreis				EUR		1,249.83	
Rücknahmepreis				EUR		1,249.83	
Anteile im Umlauf				STK		17,261.838	

*) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Devisentermingeschäfte zum 30.06.2024

	Währung	Betrag		Währung	Betrag	Fälligkeit	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Verkauf	CHF	-2,660,000.00	Kauf	EUR	2,747,435.77	05.07.2024	-17,083.68	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	GBP	-2,182,000.00	Kauf	EUR	2,563,013.78	05.07.2024	-10,594.34	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	JPY	-2,099,000,000.00	Kauf	EUR	12,407,737.04	05.07.2024	220,314.38	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	JPY	-5,800,000.00	Kauf	EUR	34,214.42	05.07.2024	537.88	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	JPY	-5,800,000.00	Kauf	EUR	34,218.46	05.07.2024	541.92	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Verkauf	USD	-155,000,000.00	Kauf	EUR	142,481,032.33	05.07.2024	-2,117,152.64	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
Verkauf	USD	-1,000,000.00	Kauf	EUR	928,499.93	05.07.2024	-4,391.59	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Verkauf	USD	-1,700,000.00	Kauf	EUR	1,580,606.96	05.07.2024	-5,308.62	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	USD	-2,500,000.00	Kauf	EUR	2,326,675.69	05.07.2024	-5,553.10	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	USD	-1,280,000.00	Kauf	EUR	1,193,764.04	05.07.2024	-337.10	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Summe Devisentermingeschäfte							-1,939,026.89	

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAP01006094	04.01.2030			-10,262.29	Deutsche Bank AG New York
Floating Leg 04.01.10/04.01.30 USD 5,56973% (Floater)	1,200,000.00	USD	5.5697 variabel		
Fixed Leg 04.01.10/04.01.30 USD 4,454% (Zinssatz fest)	-1,200,000.00	USD	4.4540 fix		
SWAPIRS030048917	08.04.2026			182,808.91	UniCredit Bank AG München
Floating Leg 08.04.16/08.04.26 USD 5,56345% (Floater)	3,500,000.00	USD	5.5635 variabel		
Fixed Leg 08.04.16/08.04.26 USD 1,61375% (Zinssatz fest)	-3,500,000.00	USD	1.6138 fix		
SWAPIRS030083205	13.04.2028			432,806.89	J.P. Morgan SE FrankfurtGoldman Sachs International Limited London
Floating Leg 13.04.18/13.04.28 EUR 3,906% (Floater)	6,000,000.00	EUR	3.9060 variabel		
Fixed Leg 13.04.18/13.04.28 EUR 0,8445% (Zinssatz fest)	-6,000,000.00	EUR	0.8445 fix		
SWAPIRS030092104	23.10.2028			35,226.80	J.P. Morgan SE FrankfurtGoldman Sachs International Limited London
Floating Leg 23.10.18/23.10.28 JPY 0,04761% (Floater)	470,000,000.00	JPY	0.0476 variabel		
Fixed Leg 23.10.18/23.10.28 JPY 0,3775% (Zinssatz fest)	-470,000,000.00	JPY	0.3775 fix		
SWAPIRS110555	24.01.2025			66,073.71	J.P. Morgan SE Frankfurt
Floating Leg 24.01.20/24.01.25 EUR 3,891% (Floater)	3,000,000.00	EUR	3.8910 variabel		
Fixed Leg 24.01.20/24.01.25 EUR -0,247% (Zinssatz fest)	-3,000,000.00	EUR	-0.2470 fix		
SWAPIRS110830	04.02.2030			256,705.58	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 04.02.20/04.02.30 USD 5,59754% (Floater)	2,000,000.00	USD	5.5975 variabel		
Fixed Leg 04.02.20/04.02.30 USD 1,4795% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	USD	1.4795 fix		
SWAPIRS111915	10.03.2028			381,680.58	Deutsche Bank AG London
Floating Leg 10.03.20/10.03.28 USD 5,59605% (Floater)	3,300,000.00	USD	5.5961 variabel		
Fixed Leg 10.03.20/10.03.28 USD 0,771% (Zinssatz fest)	-3,300,000.00	USD	0.7710 fix		
SWAPIRS113038	24.03.2025			201,353.35	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 24.03.20/24.03.25 USD 5,60907% (Floater)	6,300,000.00	USD	5.6091 variabel		
Fixed Leg 24.03.20/24.03.25 USD 0,6625% (Zinssatz fest)	-6,300,000.00	USD	0.6625 fix		
SWAPIRS115737	16.06.2027			206,712.77	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 16.06.20/16.06.27 USD 5,60083% (Floater)	2,000,000.00	USD	5.6008 variabel		
Fixed Leg 16.06.20/16.06.27 USD 0,5295% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	USD	0.5295 fix		
SWAPIRS118372	28.08.2024			33,321.43	Deutsche Bank AG London
Floating Leg 28.08.20/28.08.24 EUR 3,808% (Floater)	4,700,000.00	EUR	3.8080 variabel		
Fixed Leg 28.08.20/28.08.24 EUR -0,442% (Zinssatz fest)	-4,700,000.00	EUR	-0.4420 fix		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS118374	28.08.2025			43,246.64	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 28.08.20/28.08.25 EUR 3,808% (Floater)	1,000,000.00	EUR	3.8080 variabel		
Fixed Leg 28.08.20/28.08.25 EUR -0,415% (Zinssatz fest)	-1,000,000.00	EUR	-0.4150 fix		
SWAPIRS118378	28.08.2027			225,032.65	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 28.08.20/28.08.27 EUR 3,808% (Floater)	2,300,000.00	EUR	3.8080 variabel		
Fixed Leg 28.08.20/28.08.27 EUR -0,337% (Zinssatz fest)	-2,300,000.00	EUR	-0.3370 fix		
SWAPIRS118516	02.09.2026			283,295.33	Deutsche Bank AG London
Floating Leg 02.09.20/02.09.26 USD 5,60769% (Floater)	3,400,000.00	USD	5.6077 variabel		
Fixed Leg 02.09.20/02.09.26 USD 0,42% (Zinssatz fest)	-3,400,000.00	USD	0.4200 fix		
SWAPIRS119826	19.10.2025			112,058.51	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 19.10.20/19.10.25 USD 5,58817% (Floater)	2,000,000.00	USD	5.5882 variabel		
Fixed Leg 19.10.20/19.10.25 USD 0,3725% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	USD	0.3725 fix		
SWAPIRS122015	28.01.2026			381,045.58	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 28.01.21/28.01.26 USD 5,58648% (Floater)	6,000,000.00	USD	5.5865 variabel		
Fixed Leg 28.01.21/28.01.26 USD 0,515% (Zinssatz fest)	-6,000,000.00	USD	0.5150 fix		
SWAPIRS122553	24.02.2025			122,270.88	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 24.02.21/24.02.25 USD 5,59246% (Floater)	4,100,000.00	USD	5.5925 variabel		
Fixed Leg 24.02.21/24.02.25 USD 0,5225% (Zinssatz fest)	-4,100,000.00	USD	0.5225 fix		
SWAPIRS127146	10.06.2025			71,697.76	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 10.06.21/10.06.25 EUR 3,755% (Floater)	2,000,000.00	EUR	3.7550 variabel		
Fixed Leg 10.06.21/10.06.25 EUR -0,396% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	EUR	-0.3960 fix		
SWAPIRS133641	16.02.2029			219,219.74	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 16.02.22/16.02.29 USD 5,31647% (Floater)	2,400,000.00	USD	5.3159 variabel		
Fixed Leg 16.02.22/16.02.29 USD 1,7019% (Zinssatz fest)	-2,400,000.00	USD	1.7019 fix		
SWAPIRS142633	16.08.2024			12,900.25	Deutsche Bank AG London
Floating Leg 16.08.22/16.08.24 EUR 3,824% (Floater)	3,700,000.00	EUR	3.8240 variabel		
Fixed Leg 16.08.22/16.08.24 EUR 1,305% (Zinssatz fest)	-3,700,000.00	EUR	1.3050 fix		
SWAPIRS146918	21.11.2032			149,540.22	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 21.11.22/21.11.32 USD 5,31946% (Floater)	4,900,000.00	USD	5.3192 variabel		
Fixed Leg 21.11.22/21.11.32 USD 3,427% (Zinssatz fest)	-4,900,000.00	USD	3.4270 fix		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS146921	21.11.2027			72,974.26	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 21.11.22/21.11.27 USD 5,31946% (Floater)	5,000,000.00	USD	5.3192 variabel		
Fixed Leg 21.11.22/21.11.27 USD 3,7095% (Zinssatz fest)	-5,000,000.00	USD	3.7095 fix		
SWAPIRS147125	23.11.2028			11,580.00	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 23.11.22/23.11.28 EUR 3,823% (Floater)	1,400,000.00	EUR	3.8230 variabel		
Fixed Leg 23.11.22/23.11.28 EUR 2,647% (Zinssatz fest)	-1,400,000.00	EUR	2.6470 fix		
SWAPIRS147127	23.11.2031			63,864.47	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 23.11.22/23.11.31 USD 5,31949% (Floater)	2,700,000.00	USD	5.3192 variabel		
Fixed Leg 23.11.22/23.11.31 USD 3,509% (Zinssatz fest)	-2,700,000.00	USD	3.5090 fix		
SWAPIRS147318	05.12.2028			103,010.47	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 05.12.22/05.12.28 USD 5,31816% (Floater)	4,200,000.00	USD	5.3178 variabel		
Fixed Leg 05.12.22/05.12.28 USD 3,411% (Zinssatz fest)	-4,200,000.00	USD	3.4110 fix		
SWAPIRS148229	21.12.2030			34,620.61	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 21.12.22/21.12.30 USD 3,28% (Floater)	1,000,000.00	USD	5.3181 variabel		
Fixed Leg 21.12.22/21.12.30 USD 3,28% (Zinssatz fest)	-1,000,000.00	USD	3.2800 fix		
SWAPIRS148560	13.01.2031			105,280.72	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 13.01.23/13.01.31 USD 5,31554% (Floater)	3,000,000.00	USD	5.3151 variabel		
Fixed Leg 13.01.23/13.01.31 USD 3,274% (Zinssatz fest)	-3,000,000.00	USD	3.2740 fix		
SWAPIRS148684	20.01.2028			126,711.82	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 20.01.23/20.01.28 USD 5,31565% (Floater)	4,500,000.00	USD	5.3152 variabel		
Fixed Leg 20.01.23/20.01.28 USD 3,2595% (Zinssatz fest)	-4,500,000.00	USD	3.2595 fix		
SWAPIRS148686	20.01.2033			203,932.67	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 20.01.23/20.01.33 USD 5,31565% (Floater)	4,000,000.00	USD	5.3152 variabel		
Fixed Leg 20.01.23/20.01.33 USD 3,128% (Zinssatz fest)	-4,000,000.00	USD	3.1280 fix		
SWAPIRS148839	01.02.2033			65,201.09	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 01.02.23/01.02.33 USD 5,31558% (Floater)	1,500,000.00	USD	5.3151 variabel		
Fixed Leg 01.02.23/01.02.33 USD 3,2415% (Zinssatz fest)	-1,500,000.00	USD	3.2415 fix		
SWAPIRS152259	17.04.2027			80,860.45	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 17.04.23/17.04.27 USD 5,31904% (Floater)	3,500,000.00	USD	5.3181 variabel		
Fixed Leg 17.04.23/17.04.27 USD 3,379% (Zinssatz fest)	-3,500,000.00	USD	3.3790 fix		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Kupon	Unrealisiertes Ergebnis	Gegenpartei
	Nominale 1	Whg 2	in %	in EUR	
Zinsswaps	Nominale 2				
SWAPIRS152261	17.04.2029			33,319.96	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 17.04.23/17.04.29 USD 5,31904% (Floater)	1,000,000.00	USD	5.3181 variabel		
Fixed Leg 17.04.23/17.04.29 USD 3,2% (Zinssatz fest)	-1,000,000.00	USD	3.2000 fix		
SWAPIRS152262	17.04.2033			82,806.76	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 17.04.23/17.04.33 USD 5,31904% (Floater)	1,600,000.00	USD	5.3181 variabel		
Fixed Leg 17.04.23/17.04.33 USD 3,13% (Zinssatz fest)	-1,600,000.00	USD	3.1300 fix		
SWAPIRS153015	19.05.2032			62,714.17	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 19.05.23/19.05.32 USD 5,32463% (Floater)	1,500,000.00	USD	5.3234 variabel		
Fixed Leg 19.05.23/19.05.32 USD 3,227% (Zinssatz fest)	-1,500,000.00	USD	3.2270 fix		
SWAPIRS153109	25.05.2027			66,117.64	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 25.05.23/25.05.27 USD 5,32629% (Floater)	4,300,000.00	USD	5.3250 variabel		
Fixed Leg 25.05.23/25.05.27 USD 3,686% (Zinssatz fest)	-4,300,000.00	USD	3.6860 fix		
SWAPIRS153110	25.05.2030			84,949.47	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 25.05.23/25.05.30 USD 5,32629% (Floater)	3,700,000.00	USD	5.3250 variabel		
Fixed Leg 25.05.23/25.05.30 USD 3,4825% (Zinssatz fest)	-3,700,000.00	USD	3.4825 fix		
SWAPIRS153430	15.06.2028			53,313.13	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 15.06.23/15.06.28 USD 5,31% (Floater)	3,500,000.00	USD	5.3200 variabel		
Fixed Leg 15.06.23/15.06.28 USD 3,6585% (Zinssatz fest)	-3,500,000.00	USD	3.6585 fix		
SWAPIRS153432	15.06.2033			32,575.28	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 15.06.23/15.06.33 USD 5,32714% (Floater)	1,100,000.00	USD	5.3236 variabel		
Fixed Leg 15.06.23/15.06.33 USD 3,454% (Zinssatz fest)	-1,100,000.00	USD	3.4540 fix		
SWAPIRS153434	15.06.2028			-11,255.93	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 15.06.23/15.06.28 EUR 3,719% (Floater)	2,000,000.00	EUR	3.7190 variabel		
Fixed Leg 15.06.23/15.06.28 EUR 3,02% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	EUR	3.0200 fix		
SWAPIRS153444	16.06.2029			63,750.80	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 16.06.23/16.06.29 USD 3,19% (Floater)	4,500,000.00	USD	3.1900 variabel		
Fixed Leg 16.06.23/16.06.29 USD 3,667% (Zinssatz fest)	-4,500,000.00	USD	3.6670 fix		
SWAPIRS153492	20.06.2033			50,764.57	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 20.06.23/20.06.33 USD 5,32636% (Floater)	2,250,000.00	USD	5.3213 variabel		
Fixed Leg 20.06.23/20.06.33 USD 3,555% (Zinssatz fest)	-2,250,000.00	USD	3.5550 fix		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Kupon	Unrealisiertes Ergebnis	Gegenpartei
	Nominale 1	Whg 2	in %	in EUR	
Zinsswaps	Nominale 2				
SWAPIRS153495	20.06.2027			21,211.65	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 20.06.23/20.06.27 USD 5,32636% (Floater)	2,000,000.00	USD	5.3213 variabel		
Fixed Leg 20.06.23/20.06.27 USD 3,8625% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	USD	3.8625 fix		
SWAPIRS153562	23.06.2026			14,825.71	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 23.06.23/23.06.26 USD 5,33429% (Floater)	2,500,000.00	USD	5.3300 variabel		
Fixed Leg 23.06.23/23.06.26 USD 4,2132% (Zinssatz fest)	-2,500,000.00	USD	4.2132 fix		
SWAPIRS153653	28.06.2026			35,174.70	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 28.06.23/28.06.26 USD 5,34% (Floater)	5,100,000.00	USD	5.2950 variabel		
Fixed Leg 28.06.23/28.06.26 USD 4,153% (Zinssatz fest)	-5,100,000.00	USD	4.1530 fix		
SWAPIRS153945	10.07.2026			462.09	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 10.07.23/10.07.26 USD 5,30305% (Floater)	2,200,000.00	USD	5.3027 variabel		
Fixed Leg 10.07.23/10.07.26 USD 4,523% (Zinssatz fest)	-2,200,000.00	USD	4.5230 fix		
SWAPIRS154060	11.07.2033			17,400.43	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 11.07.23/11.07.33 USD 5,30374% (Floater)	2,900,000.00	USD	5.2535 variabel		
Fixed Leg 11.07.23/11.07.33 USD 3,79125% (Zinssatz fest)	-2,900,000.00	USD	3.7913 fix		
SWAPIRS154106	13.07.2030			22,478.09	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 13.07.23/13.07.30 USD 5,30514% (Floater)	3,600,000.00	USD	5.3048 variabel		
Fixed Leg 13.07.23/13.07.30 USD 3,821% (Zinssatz fest)	-3,600,000.00	USD	3.8210 fix		
SWAPIRS154200	17.07.2031			41,598.62	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 17.07.23/17.07.31 USD (Floater)	2,300,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 17.07.23/17.07.31 USD 3,5937% (Zinssatz fest)	-2,300,000.00	USD	3.5937 fix		
SWAPIRS154252	20.07.2027			12,792.51	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 20.07.23/20.07.27 JPY (Floater)	270,000,000.00	JPY	variabel		
Fixed Leg 20.07.23/20.07.27 JPY 0,2585% (Zinssatz fest)	-270,000,000.00	JPY	0.2585 fix		
SWAPIRS154258	21.07.2030			12,123.79	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 21.07.23/21.07.30 JPY (Floater)	130,000,000.00	JPY	variabel		
Fixed Leg 21.07.23/21.07.30 JPY 0,481% (Zinssatz fest)	-130,000,000.00	JPY	0.4810 fix		
SWAPIRS154418	01.08.2026			8,959.05	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 01.08.23/01.08.26 JPY (Floater)	300,000,000.00	JPY	variabel		
Fixed Leg 01.08.23/01.08.26 JPY 0,1835% (Zinssatz fest)	-300,000,000.00	JPY	0.1835 fix		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS154516	02.08.2028			9,786.29	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 02.08.23/02.08.28 JPY (Floater)	180,000,000.00	JPY	variabel		
Fixed Leg 02.08.23/02.08.28 JPY 0,376% (Zinssatz fest)	-180,000,000.00	JPY	0.3760 fix		
SWAPIRS154847	14.08.2031			8,863.76	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 14.08.23/14.08.31 USD 5,31624% (Floater)	1,100,000.00	USD	5.3160 variabel		
Fixed Leg 14.08.23/14.08.31 USD 3,771% (Zinssatz fest)	-1,100,000.00	USD	3.7710 fix		
SWAPIRS156293	11.09.2027			-11,282.38	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 11.09.23/11.09.27 USD 5,31% (Floater)	4,400,000.00	USD	5.3100 variabel		
Fixed Leg 11.09.23/11.09.27 USD 4,3308% (Zinssatz fest)	-4,400,000.00	USD	4.3308 fix		
SWAPIRS156484	08.09.2033			-22,220.68	BNP Paribas S.A. (GD) Frankfurt (V)
Floating Leg 08.09.23/08.09.33 USD (Floater)	2,600,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 08.09.23/08.09.33 USD 3,9973% (Zinssatz fest)	-2,600,000.00	USD	3.9973 fix		
SWAPIRS156685	21.09.2031			3,061.88	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 21.09.23/21.09.31 JPY (Floater)	130,000,000.00	JPY	variabel		
Fixed Leg 21.09.23/21.09.31 JPY 0,78625% (Zinssatz fest)	-130,000,000.00	JPY	0.7863 fix		
SWAPIRS156808	25.09.2026			-8,266.15	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 25.09.23/25.09.26 USD 5,31825% (Floater)	1,800,000.00	USD	5.3180 variabel		
Fixed Leg 25.09.23/25.09.26 USD 4,72% (Zinssatz fest)	-1,800,000.00	USD	4.7200 fix		
SWAPIRS157231	27.09.2026			-6,598.52	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 27.09.23/27.09.26 USD 5,31831% (Floater)	1,700,000.00	USD	5.3181 variabel		
Fixed Leg 27.09.23/27.09.26 USD 4,681% (Zinssatz fest)	-1,700,000.00	USD	4.6810 fix		
SWAPIRS157352	03.10.2025			-11,788.84	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 03.10.23/03.10.25 CHF (Floater)	1,700,000.00	CHF	variabel		
Fixed Leg 03.10.23/03.10.25 CHF 1,71% (Zinssatz fest)	-1,700,000.00	CHF	1.7100 fix		
SWAPIRS158157	16.10.2027			-12,596.45	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 16.10.23/16.10.27 USD 5,31869% (Floater)	1,500,000.00	USD	5.3184 variabel		
Fixed Leg 16.10.23/16.10.27 USD 4,52% (Zinssatz fest)	-1,500,000.00	USD	4.5200 fix		
SWAPIRS158671	23.10.2033			-26,299.63	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 23.10.23/23.10.33 USD (Floater)	500,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 23.10.23/23.10.33 USD 4,6061% (Zinssatz fest)	-500,000.00	USD	4.6061 fix		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS158898	20.10.2027			-18,748.22	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 20.10.23/20.10.27 USD (Floater)	1,300,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 20.10.23/20.10.27 USD 4,7304% (Zinssatz fest)	-1,300,000.00	USD	4.7304 fix		
SWAPIRS160641	04.12.2030			5,075.02	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 04.12.23/04.12.30 USD 5,31848% (Floater)	3,600,000.00	USD	5.3182 variabel		
Fixed Leg 04.12.23/04.12.30 USD 3,911% (Zinssatz fest)	-3,600,000.00	USD	3.9110 fix		
SWAPIRS162740	10.01.2029			39,045.52	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 10.01.24/10.01.29 GBP (Floater)	2,100,000.00	GBP	variabel		
Fixed Leg 10.01.24/10.01.29 GBP 3,663% (Zinssatz fest)	-2,100,000.00	GBP	3.6630 fix		
SWAPIRS162744	12.01.2031			32,956.04	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 12.01.24/12.01.31 USD (Floater)	2,100,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 12.01.24/12.01.31 USD 3,639% (Zinssatz fest)	-2,100,000.00	USD	3.6390 fix		
SWAPIRS163141	01.02.2028			9,451.81	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 01.02.24/01.02.28 JPY (Floater)	320,000,000.00	JPY	variabel		
Fixed Leg 01.02.24/01.02.28 JPY 0,42625% (Zinssatz fest)	-320,000,000.00	JPY	0.4263 fix		
SWAPIRS164405	07.03.2031			13,008.01	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 07.03.24/07.03.31 USD (Floater)	3,200,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 07.03.24/07.03.31 USD 3,853% (Zinssatz fest)	-3,200,000.00	USD	3.8530 fix		
SWAPIRS164782	14.03.2031			12,274.35	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 14.03.24/14.03.31 USD (Floater)	1,600,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 14.03.24/14.03.31 USD 3,786% (Zinssatz fest)	-1,600,000.00	USD	3.7860 fix		
SWAPIRS164854	19.03.2031			-4,917.56	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 19.03.24/19.03.31 USD 5,31856% (Floater)	4,200,000.00	USD	5.3179 variabel		
Fixed Leg 19.03.24/19.03.31 USD 3,948% (Zinssatz fest)	-4,200,000.00	USD	3.9480 fix		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS165652	05.04.2026			3,349.64	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 05.04.24/05.04.26 USD 5,31793% (Floater)	5,300,000.00	USD	5.3171 variabel		
Fixed Leg 05.04.24/05.04.26 USD 4,626% (Zinssatz fest)	-5,300,000.00	USD	4.6260 fix		
SWAPIRS167566	13.06.2029			-22,395.09	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 13.06.24/13.06.29 USD (Floater)	2,800,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 13.06.24/13.06.29 USD 4,202% (Zinssatz fest)	-2,800,000.00	USD	4.2020 fix		
Zinsswaps gesamt				4,972,613.14	

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS030079605	20.12.2027			419,932.81	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.06.19/20.12.27 USD Banque Centrale de Tunisie DL-Notes 1997(27)	4,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.19/20.12.27 USD 1%	-4,000,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS030079850	20.12.2027			524,916.01	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.06.19/20.12.27 USD Banque Centrale de Tunisie DL-Notes 1997(27)	5,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.19/20.12.27 USD 1%	-5,000,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS030086904	20.06.2028			17,883.76	Goldman Sachs International Limited London
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	125,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-125,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS030087009	20.06.2028			8,941.88	Goldman Sachs International Limited London
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	62,500,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-62,500,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS030087305	20.06.2028			22,354.70	Goldman Sachs International Limited London
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	156,250,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-156,250,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS030087406	20.06.2028			18,828.03	Goldman Sachs International Limited London
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	131,600,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-131,600,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS030087809	20.06.2028			24,364.84	Goldman Sachs International Limited London
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	170,300,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-170,300,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS030087810	20.06.2028			7,153.50	Goldman Sachs International Limited London
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	50,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-50,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS030087828	20.06.2028			14,993.75	Goldman Sachs International Limited London
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	104,800,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-104,800,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS114403	20.06.2025			-35,730.58	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Level 3 Financing Inc. DL-Notes 2015(15/22)	850,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	-850,000.00	USD	5.0000		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS116954	20.06.2028			75,211.95	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 22.06.20/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	525,700,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 22.06.20/20.06.28 JPY 1%	-525,700,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS118350	20.03.2026			-72,877.47	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31)	950,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	-950,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS118351	20.03.2026			-72,877.47	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31)	950,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	-950,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS118644	20.03.2026			-72,877.47	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31)	950,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	-950,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS118645	20.03.2026			-72,877.47	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31)	950,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	-950,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS127164	20.03.2026			-2,542.57	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 22.03.21/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28)	450,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 22.03.21/20.03.26 USD 1%	-450,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS127311	20.03.2026			-5,480.65	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 22.03.21/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28)	970,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 22.03.21/20.03.26 USD 1%	-970,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS128123	20.06.2026			-141,409.10	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 21.06.21/20.06.26 USD MGIC Investment Corp. DL-Notes 2016(16/23)	1,700,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.06.21/20.06.26 USD 5%	-1,700,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS135207	20.09.2025			-8,825.90	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 21.03.22/20.09.25 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26)	980,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.03.22/20.09.25 USD 1%	-980,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS136158	20.03.2026			-9,322.76	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 21.03.22/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28)	1,650,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.03.22/20.03.26 USD 1%	-1,650,000.00	USD	1.0000		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS138056	20.06.2027			-13,527.85	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 21.03.22/20.06.27 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26)	1,160,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.03.22/20.06.27 USD 1%	-1,160,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS138439	20.06.2027			-5,830.97	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 21.03.22/20.06.27 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26)	500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.03.22/20.06.27 USD 1%	-500,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS139736	20.03.2026			-8,475.24	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 21.03.22/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28)	1,500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.03.22/20.03.26 USD 1%	-1,500,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS140334	20.03.2025			-8,231.59	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 21.06.22/20.03.25 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26)	1,390,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.06.22/20.03.25 USD 1%	-1,390,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS143162	20.06.2027			-156,135.38	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.27 USD MGIC Investment Corp. DL-Notes 2020(20/28)	1,330,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.27 USD 5%	-1,330,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS143171	20.06.2027			-92,742.07	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.27 USD MGIC Investment Corp. DL-Notes 2020(20/28)	790,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.27 USD 5%	-790,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS143419	20.06.2027			-78,883.20	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.27 USD Unisys Corp. DL-Notes 2020(20/27) 144A	2,050,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.27 USD 5%	-2,050,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS143621	20.06.2027			-38,479.61	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.27 USD Unisys Corp. DL-Notes 2020(20/27) 144A	1,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.27 USD 5%	-1,000,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS146109	20.09.2025			-16,882.12	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22)	950,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.09.25 EUR 5%	-950,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS146110	20.09.2025			-16,882.12	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22)	950,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.09.25 EUR 5%	-950,000.00	EUR	5.0000		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS146738	20.12.2025			-1,214.46	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	150,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	-150,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146739	20.12.2027			-6,592.10	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	800,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	-800,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146740	20.12.2027			-5,768.09	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	700,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	-700,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146741	20.12.2029			523.37	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	150,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	-150,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146742	20.12.2032			58,412.99	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	2,400,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	-2,400,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146743	20.12.2032			51,111.37	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	2,100,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	-2,100,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146744	20.12.2032			20,687.93	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	850,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	-850,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146746	20.09.2025			-5,763.85	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.09.25 USD Teva Pharmaco.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26)	640,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.09.25 USD 1%	-640,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS146792	20.12.2025			-2,428.93	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	300,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	-300,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146793	20.12.2027			-2,472.04	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	300,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	-300,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS146794 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 300,000.00 -300,000.00	EUR EUR	1.0000	1,046.74	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146795 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	20.12.2032 1,700,000.00 -1,700,000.00	EUR EUR	1.0000	41,375.87	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146796 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 250,000.00 -250,000.00	EUR EUR	1.0000	-2,563.44	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146797 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 250,000.00 -250,000.00	EUR EUR	1.0000	-4,304.33	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146798 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.28 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.28 EUR 1%	20.12.2028 1,800,000.00 -1,800,000.00	EUR EUR	1.0000	-29,797.50	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS147111 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 500,000.00 -500,000.00	EUR EUR	1.0000	-6,512.12	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS147112 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 912,500.00 -912,500.00	EUR EUR	1.0000	-8,477.89	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS147113 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 1,010,000.00 -1,010,000.00	EUR EUR	1.0000	-9,383.74	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS147114 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 730,000.00 -730,000.00	EUR EUR	1.0000	-6,782.31	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS147270 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 1,600,000.00 -1,600,000.00	EUR EUR	1.0000	-20,838.79	Bank of America Securities Europe SA - Paris

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS147291	20.12.2027			-50,896.86	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SENIOR	2,720,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	-2,720,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148199	20.12.2029			6,437.85	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	195,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 JPY 1%	-195,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS148224	20.12.2029			6,041.67	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	183,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 JPY 1%	-183,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS148443	20.06.2028			-13,090.34	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.28 EUR Societe Generale SRO LAC	1,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.28 EUR 1%	-1,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148514	20.12.2025			-3,036.16	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	375,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 EUR 1%	-375,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148515	20.12.2027			-3,090.05	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	375,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 EUR 1%	-375,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148516	20.12.2029			1,308.42	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	375,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 EUR 1%	-375,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148517	20.12.2032			51,719.84	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	2,125,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.32 EUR 1%	-2,125,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148518	20.12.2027			-4,671.02	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	82,500,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 JPY 1%	-82,500,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS148624	20.12.2025			-1,860.30	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	30,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 JPY 1%	-30,000,000.00	JPY	1.0000		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS148625	20.09.2027			-20,948.27	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.12.22/20.09.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	325,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.09.27 JPY 1%	-325,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS148628	20.06.2026			-18,050.62	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.26 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRRE	1,250,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.26 EUR 1%	-1,250,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148720	20.12.2027			-2,491.21	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	44,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 JPY 1%	-44,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS148721	20.12.2029			6,437.85	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	195,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 JPY 1%	-195,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS148722	20.12.2025			-1,435.52	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S	140,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 EUR 1%	-140,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148723	20.12.2027			-16,700.79	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S	970,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 EUR 1%	-970,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS149166	20.09.2030			3,304.34	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.09.30 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	51,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.09.30 JPY 1%	-51,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS149212	20.12.2025			-1,550.25	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	25,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 JPY 1%	-25,000,000.00	JPY	1.0000		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS150375	20.09.2027			-114,750.42	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.12.22/20.09.27 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	900,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.09.27 USD 5%	-900,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS151285	20.12.2025			-166,583.75	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 USD Pactiv LLC DL-Notes 1999(25)	2,500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 USD 5%	-2,500,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS152254	20.06.2028			-13,090.34	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR Societe Generale SRO LAC	1,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 1%	-1,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS152256	20.06.2032			-6,503.58	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRRE	700,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.32 EUR 1%	-700,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS152305	20.06.2032			-10,777.37	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRRE	1,160,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.32 EUR 1%	-1,160,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS152712	20.06.2028			-16,739.91	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRRE	1,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 1%	-1,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS153011	20.06.2028			-33,479.82	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRRE	2,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 1%	-2,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS153115	20.06.2028			-5,130.91	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	125,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 JPY 1%	-125,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS153116	20.06.2030			27,114.02	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.30 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	500,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.30 JPY 1%	-500,000,000.00	JPY	1.0000		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS153278	20.06.2028			-64,887.03	HSBC Continental Europe S.A. - Paris
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR TK Elevator Holdco GmbH Anleihe v.20(20/28) Reg.S	1,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 5%	-1,000,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS153322	20.03.2026			-9,322.76	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28)	1,650,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.26 USD 1%	-1,650,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS153424	20.06.2028			-312,972.95	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 USD Louisiana Pacific Corp. DL-Notes 2021(21/29) 144A	2,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 USD 5%	-2,000,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS153425	20.06.2028			-156,486.47	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 USD Louisiana Pacific Corp. DL-Notes 2021(21/29) 144A	1,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 USD 5%	-1,000,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS153426	20.12.2027			-66,286.64	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.03.23/20.12.27 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S	3,850,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.12.27 EUR 1%	-3,850,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS153451	20.12.2029			-55,353.05	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.03.23/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2020(25)	4,250,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.12.29 EUR 1%	-4,250,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS153487	20.06.2033			761.78	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.33 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2020(25)	2,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.33 EUR 1%	-2,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS153488	20.03.2027			-19,683.60	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.27 EUR Societe Generale SRO LAC	2,125,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.27 EUR 1%	-2,125,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS153545	20.06.2033			761.78	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.33 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2020(25)	2,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.33 EUR 1%	-2,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS153546	20.06.2033			761.78	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.33 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2020(25)	2,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.33 EUR 1%	-2,500,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS153564	20.12.2025			-24,831.77	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.25 EUR Societe Generale SRO LAC	3,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.25 EUR 1%	-3,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS153655	20.12.2025			-49,663.53	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.25 EUR Societe Generale SRO LAC	6,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.25 EUR 1%	-6,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS154044	20.12.2025			-21,107.00	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.25 EUR Societe Generale SRO LAC	2,550,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.25 EUR 1%	-2,550,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS154051	20.06.2028			-5,492.93	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.28 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	1,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.28 EUR 1%	-1,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS154052	20.12.2032			109,524.36	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(25)	4,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.32 EUR 1%	-4,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS154076	20.03.2026			-10,735.30	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28)	1,900,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.03.26 USD 1%	-1,900,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS154109	20.06.2028			-18,471.26	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.28 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	450,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.28 JPY 1%	-450,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS154196	20.06.2028			-58,589.68	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.28 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRRE	3,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.28 EUR 1%	-3,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS154203	20.12.2028			97,325.74	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 JPY Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2017(27) No. 9	180,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 JPY 1%	-180,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS154224	20.12.2028			145,988.60	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 JPY Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2017(27) No. 9	270,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 JPY 1%	-270,000,000.00	JPY	1.0000		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS154287	20.12.2028			145,988.60	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 JPY Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2017(27) No. 9	270,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 JPY 1%	-270,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS154302	20.12.2028			51,366.36	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 JPY Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2017(27) No. 9	95,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 JPY 1%	-95,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS154413	20.12.2031			76,689.88	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.31 JPY Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2017(27) No. 9	85,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.31 JPY 1%	-85,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS154429	20.12.2031			76,689.88	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.31 JPY Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2017(27) No. 9	85,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.31 JPY 1%	-85,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS154512	20.12.2028			108,139.71	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 JPY Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2017(27) No. 9	200,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 JPY 1%	-200,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS154513	20.12.2031			76,689.88	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.31 JPY Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2017(27) No. 9	85,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.31 JPY 1%	-85,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS154835	20.06.2028			30,526.28	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.28 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2018(18/28)	4,150,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.28 USD 1%	-4,150,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS154850	20.06.2028			-26,783.85	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.28 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRRE	1,600,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.28 EUR 1%	-1,600,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS155851	20.06.2027			-11,661.94	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.27 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26)	1,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.27 USD 1%	-1,000,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS155858	20.09.2025			-19,903.13	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22)	1,120,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.09.25 EUR 5%	-1,120,000.00	EUR	5.0000		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS155860	20.12.2027			-71,742.31	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.27 EUR TK Elevator Holdco GmbH Anleihe v.20(20/28) Reg.S	1,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.27 EUR 5%	-1,000,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS156269	20.09.2027			-203,480.07	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.09.27 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31)	1,500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.09.27 USD 5%	-1,500,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS156270	20.09.2027			-339,133.45	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.09.27 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31)	2,500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.09.27 USD 5%	-2,500,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS156271	20.12.2028			-26,710.54	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	1,640,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 EUR 1%	-1,640,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS156289	20.06.2027			-176,059.92	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.27 USD Pactiv LLC DL-Notes 1999(25)	1,400,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.27 USD 5%	-1,400,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS156348	20.06.2026			-70,292.48	HSBC Continental Europe S.A. - Paris
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.26 EUR Dufry One B.V. EO-Notes 2017(17/24)	900,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.26 EUR 5%	-900,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS156417	20.03.2025			-5,922.01	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.03.25 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26)	1,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.03.25 USD 1%	-1,000,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS156929	20.06.2026			-26,714.92	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.23/20.06.26 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRRE	1,850,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.06.26 EUR 1%	-1,850,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS157220	20.06.2026			-25,992.90	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.09.23/20.06.26 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRRE	1,800,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.06.26 EUR 1%	-1,800,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS157284	20.03.2025			-13,028.42	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.23/20.03.25 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26)	2,200,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.03.25 USD 1%	-2,200,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS157354	20.06.2026			-56,624.50	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.23/20.06.26 EUR Dufry One B.V. EO-Notes 2017(17/24)	725,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.06.26 EUR 5%	-725,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS158153	20.12.2027			-209,411.26	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.23/20.12.27 USD Boyd Gaming Corp. DL-Notes 2015(15/23)	1,750,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.12.27 USD 5%	-1,750,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS158154	20.09.2027			-114,750.42	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.23/20.09.27 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	900,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.09.27 USD 5%	-900,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS158155	20.09.2027			-172,125.62	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.09.23/20.09.27 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	1,350,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.09.27 USD 5%	-1,350,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS158622	20.09.2027			-208,103.59	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.09.27 USD Amkor Technology Inc. DL-Notes 2019(19/27) 144A	1,600,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.09.27 USD 5%	-1,600,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS158623	20.12.2027			-299,158.94	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.27 USD Boyd Gaming Corp. DL-Notes 2015(15/23)	2,500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.27 USD 5%	-2,500,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS158678	20.06.2033			548.48	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.33 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	1,800,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.33 EUR 1%	-1,800,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS160828	20.12.2028			-13,437.34	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	1,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 EUR 1%	-1,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS160846	20.12.2028			-2,816.68	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(25	1,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 EUR 1%	-1,000,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS162463	20.03.2029			59,921.71	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.23/20.03.29 EUR COMMERZBANK Aktiengesellschaft SRO SUB	2,100,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.03.29 EUR 1%	-2,100,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS162756	20.06.2029			-48,266.45	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.23/20.06.29 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SENIOR	2,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.06.29 EUR 1%	-2,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS163911	20.06.2027			58,329.73	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.12.23/20.06.27 USD Transocean Inc. DL-Notes 2020(20/27) 144A	2,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.06.27 USD 1%	-2,000,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS163913	20.12.2025			365.80	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.12.23/20.12.25 USD Transocean Inc. DL-Notes 2020(20/27) 144A	200,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.12.25 USD 1%	-200,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS164759	20.06.2030			-263,300.71	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.12.23/20.06.30 USD DaVita Inc. DL-Notes 2020(20/30) 144A	1,500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.06.30 USD 5%	-1,500,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS164855	20.06.2029			-119,962.29	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.12.23/20.06.29 EUR Sodexo S.A. EO-Notes 2014(14/26)	3,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.06.29 EUR 1%	-3,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS164922	20.06.2026			-19,904.25	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.26 EUR UBS AG SRO SENIOR	1,360,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.26 EUR 1%	-1,360,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS165215	20.06.2034			306,312.89	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.34 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SUB	3,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.34 EUR 1%	-3,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS165218	20.12.2025			-33,316.75	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.12.25 USD Pactiv LLC DL-Notes 1999(25)	500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.12.25 USD 5%	-500,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS165220	20.12.2025			-33,316.75	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.12.25 USD Pactiv LLC DL-Notes 1999(25)	500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.12.25 USD 5%	-500,000.00	USD	5.0000		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS165222	20.06.2034			-101,291.90	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.34 EUR 1%	3,000,000.00	EUR	1.0000		
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.34 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(25	-3,000,000.00	EUR			
SWAPCDS165655	20.06.2025			-332,024.02	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.25 USD Olin Corp. DL-Notes 2017(17/27)	7,500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.25 USD 5%	-7,500,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS166395	20.09.2028			-204,090.41	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.09.28 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	1,300,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.09.28 USD 5%	-1,300,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS167578	20.06.2029			-137,935.57	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.29 USD Cloud Software Group Inc. DL-Notes 2023(23/29) 144A	2,500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.29 USD 5%	-2,500,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS167581	20.12.2025			-14,071.33	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.12.25 EUR Societe Generale SRO LAC	1,700,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.12.25 EUR 1%	-1,700,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS167652	20.09.2028			-185,251.29	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.09.28 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	1,180,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.09.28 USD 5%	-1,180,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS168265	20.06.2029			-27,587.11	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.24/20.06.29 USD Cloud Software Group Inc. DL-Notes 2023(23/29) 144A	500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.24/20.06.29 USD 5%	-500,000.00	USD	5.0000		
Credit Default Swaps gesamt				-3,279,929.03	
Swaps gesamt				1,692,684.11	
Derivate gesamt				-246,342.78	

XAIA Credit Basis

XAIA Credit Basis (I) Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres	Teilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres
2022	Stück 221,885.069	EUR 239,265,920.66	EUR 1,078.33
2023	Stück 168,466.993	EUR 182,799,346.57	EUR 1,085.08
30.06.2024	Stück 168,196.993	EUR 188,877,214.12	EUR 1,122.95

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	168,466.993
Ausgegebene Anteile	2,750.000
Zurückgenommene Anteile	-3,020.000
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	168,196.993

XAIA Credit Basis

XAIA Credit Basis (G) Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Teilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2022	Stück	107.000	EUR	107,843.60	EUR	1,007.88
2023	Stück	39.000	EUR	39,676.70	EUR	1,017.35
30.06.2024	Stück	39.000	EUR	39,744.29	EUR	1,019.08

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	39.000
Ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	39.000

XAIA Credit Basis

XAIA Credit Basis (IT)

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Teilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres
2022	Stück	71,640.028	EUR	82,676,162.49	EUR 1,154.05
2023	Stück	17,261.838	EUR	20,847,316.03	EUR 1,207.71
30.06.2024	Stück	17,261.838	EUR	21,574,315.02	EUR 1,249.83

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	17,261.838
Ausgegebene Anteile	0.000
Zurückgenommene Anteile	0.000
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	17,261.838

XAIA Credit Basis II

Vermögensübersicht zum 30.06.2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Teilfondsvermögen *)
I. Vermögensgegenstände	512,680,289.52	101.14
1. Anleihen	442,782,368.18	87.36
2. Derivate	-1,884,451.35	-0.37
3. Bankguthaben	59,900,918.09	11.82
4. Sonstige Vermögensgegenstände	11,881,454.60	2.34
II. Verbindlichkeiten	-5,835,113.19	-1.14
III. Teilfondsvermögen	506,845,176.34	100.00

*) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

XAIA Credit Basis II

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2024	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens *)
Bestandspositionen				EUR		442,782,368.18	87.36
Börsengehandelte Wertpapiere				EUR		96,718,378.02	19.08
Verzinsliche Wertpapiere				EUR		96,718,378.02	19.08
0,7500 % Dufry One B.V. SF-Conv. Bonds 2021(26)	CH1105195684	%	2,600	CHF	96.239	2,599,175.94	0.51
1,0000 % Teva Pharmac.Fin.NL IV B.V. SF-Schuldversch. 2016(25)	CH0333827506	%	2,200	CHF	97.875	2,236,672.22	0.44
6,5140 % Commerzbank AG Sub.Fix to Float.MTN v.17(29)	XS1571152781	%	8,100	EUR	94.944	7,690,482.39	1.52
5,0000 % SoftBank Group Corp. EO-Notes 2018(18/28)	XS1793255941	%	16,000	EUR	98.895	15,823,149.69	3.12
2,8750 % SoftBank Group Corp. EO-Notes 2021(21/27)	XS2361254597	%	9,830	EUR	94.870	9,325,707.70	1.84
3,0000 % HSBC Holdings PLC LS-FLR Notes 2019(29/30)	XS2003500142	%	7,500	GBP	89.977	7,961,670.41	1.57
6,9500 % Bath & Body Works Inc. DL-Debts 2003(03/33)	US532716AK37	%	5,000	USD	96.965	4,524,315.67	0.89
7,6000 % Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2007(07/37)	US532716AN75	%	5,000	USD	95.895	4,474,370.35	0.88
4,1500 % FirstEnergy Corp. DL-Notes 2017(17/27) Ser.B	US337932AH00	%	3,000	USD	95.984	2,687,113.37	0.53
4,7550 % HSBC Holdings PLC DL-FLR Notes 2022(22/28)	US404280DF39	%	6,000	USD	98.289	5,503,302.99	1.09
7,4500 % New Albertsons L.P. DL-Debts. 1999(99/29)	US013104AF19	%	3,449	USD	104.245	3,355,173.21	0.66
7,2500 % Safeway Inc. DL-Debts 2001(31)	US786514BA67	%	4,000	USD	105.693	3,945,237.04	0.78
7,4500 % Safeway Inc. DL-Debts. 1997(97/27)	US786514AS84	%	1,500	USD	103.282	1,445,719.26	0.29
7,7670 % Standard Chartered PLC DL-FLR Notes 2022(27/28) 144A	US853254CN89	%	6,000	USD	106.435	5,959,409.56	1.18
2,6080 % Standard Chartered PLC DL-FLR Notes 2022(27/28) 144A	US853254CG39	%	8,500	USD	92.798	7,360,761.95	1.45
7,0180 % Standard Chartered PLC DL-Notes 2023(29/30) 144A	US853254CX61	%	12,000	USD	105.607	11,826,116.27	2.33
An regulierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				EUR		269,159,180.50	53.10
Verzinsliche Wertpapiere				EUR		269,159,180.50	53.10
9,5780 % Stonegate Pub Comp.Fin.19 PLC EO-FLR Notes 2020(20/25) Reg.S	XS2210013970	%	6,000	EUR	98.237	5,894,208.55	1.16
4,5000 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. EO-Notes 2018(18/25)	XS1813724603	%	8,612	EUR	99.795	8,594,315.50	1.70
3,7500 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. EO-Notes 2021(21/27)	XS2406607098	%	4,850	EUR	97.375	4,722,695.78	0.93
6,6250 % TK Elevator Holdco GmbH Anleihe v.20(20/28) Reg.S	XS2198191962	%	3,900	EUR	96.148	3,374,805.44	0.67
3,1250 % United Group B.V. EO-Bonds 2020(20/26)	XS2111946930	%	6,500	EUR	97.122	6,312,912.96	1.25
6,6250 % Amkor Technology Inc. DL-Notes 2019(19/27) 144A	US031652BK50	%	4,000	USD	100.025	3,733,670.52	0.74
4,7500 % Boyd Gaming Corp. DL-Notes 2020(20/27)	US103304BU40	%	9,280	USD	96.164	8,327,730.82	1.64
9,0000 % Cloud Software Group Inc. DL-Notes 2023(23/29) 144A	US18912UAA07	%	7,000	USD	96.631	6,312,243.64	1.25
4,6250 % DaVita Inc. DL-Notes 2020(20/30) 144A	US23918KAS78	%	3,822	USD	90.603	3,231,458.33	0.64
8,2480 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-FLR Pref.MTN 22(32/33) 144A	US46115HBV87	%	25,000	USD	110.741	25,835,502.20	5.10
8,2480 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-FLR Pref.MTN 22(32/33)Reg.S	XS2559133363	%	14,549	USD	110.735	15,034,358.98	2.97
6,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-Notes 2023(33) 144A X	US46115HBZ91	%	10,750	USD	103.681	10,401,000.35	2.05
6,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-Notes 2023(33) Reg.S	XS2638075700	%	8,500	USD	103.708	8,226,201.97	1.62
7,2000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-Pref.Med.-T.Nts 23(33) 144A	US46115HCD70	%	5,000	USD	107.364	5,009,516.83	0.99
4,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-Receipts 2019(29) Cl.X 144A	US46115HBL06	%	5,800	USD	92.249	4,992,941.12	0.99
4,8750 % Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	US46284VAC54	%	15,500	USD	96.558	13,966,463.44	2.76

XAIA Credit Basis II

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2024	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens *)
5,0000 % Iron Mountain Inc. DL-Notes 2020(20/28) 144A	US46284VAG68	%	2,836	USD	95.589	2,529,767.00	0.50
3,6250 % Louisiana Pacific Corp. DL-Notes 2021(21/29) 144A	US546347AM73	%	7,850	USD	90.789	6,650,737.99	1.31
5,2500 % MGIC Investment Corp. DL-Notes 2020(20/28)	US552848AG81	%	7,600	USD	96.954	6,876,176.87	1.36
4,3450 % Nissan Motor Co. Ltd. DL-Notes 2020(20/27) 144A	US654744AC50	%	2,500	USD	95.562	2,229,422.00	0.44
4,3450 % Nissan Motor Co. Ltd. DL-Notes 2020(20/27) Reg.S	USJ57160DY66	%	1,258	USD	95.569	1,121,928.24	0.22
4,8100 % Nissan Motor Co. Ltd. DL-Notes 2020(20/30) 144A	US654744AD34	%	2,000	USD	93.098	1,737,550.61	0.34
4,8100 % Nissan Motor Co. Ltd. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USJ57160DZ32	%	25,220	USD	93.082	21,906,703.51	4.32
5,3750 % Ovintiv Inc. DL-Notes 2015(15/26)	US651290AR99	%	7,870	USD	99.529	7,309,571.55	1.44
8,3750 % Pactiv LLC DL-Debts 1999(99/27)	US880394AE11	%	2,000	USD	103.355	1,928,979.29	0.38
7,9500 % Pactiv LLC DL-Notes 1999(25)	US880394AB71	%	8,472	USD	101.783	8,046,894.44	1.59
1,4880 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 20(25/26) 144A	US83368RAZ55	%	17,986	USD	93.615	15,712,582.64	3.10
1,4880 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 20(25/26)Reg.S	US83368TAZ12	%	19,050	USD	93.615	16,642,093.81	3.28
2,7970 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 22(27/28)Reg.S	US83368TBH05	%	2,500	USD	92.518	2,158,412.38	0.43
6,4460 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 23(28/29) 144A	US83368RBR21	%	5,500	USD	101.552	5,212,172.32	1.03
7,6250 % T-Mobile US Inc. DL-Notes 2018(18/26)	US85207UAK16	%	6,350	USD	102.727	6,087,338.07	1.20
6,8750 % Targa Resources Part.L.P./Fin. DL-Notes 2019(19/29)	US87612BBN10	%	7,321	USD	102.556	7,006,446.33	1.38
7,4500 % Transocean Inc. DL-Notes 1997(97/27)	US893817AA41	%	6,486	USD	96.506	5,841,153.10	1.15
5,0000 % UBS AG DL-FLR Med.-Term Nts 2016(26)	US22548Q3E34	%	3,963	USD	99.231	3,669,779.46	0.72
1,9820 % UniCredit S.p.A. DL-FLR Pref. MTN 2021(26/27)	XS2348710562	%	8,000	USD	93.236	6,960,497.85	1.37
3,1270 % UniCredit S.p.A. DL-FLR Pref. MTN 2021(31/32)	XS2348714713	%	7,000	USD	85.130	5,560,946.61	1.10
Nichtnotierte Wertpapiere				EUR		76,904,809.66	15.17
Verzinsliche Wertpapiere				EUR		76,904,809.66	15.17
0,0000 % Banco Espirito Santo S.A. EO-Medium-Term Notes 2011(16)	PTBEQBOM0010	%	14,400	EUR	29.012	4,177,698.92	0.82
0,0000 % Banco Espirito Santo S.A. EO-Medium-Term Notes 2014(17)	PTBEQKOM0019	%	6,000	EUR	29.012	1,740,707.88	0.34
0,0000 % Galapagos Holding S.A. EO-Notes 2014(17/22) Reg.S	XS1071420027	%	100	EUR	0.000	0.00	0.00
4,2000 % Banque Centrale de Tunisie YN-Bonds 2001(31)	XS0126471233	%	200,000	JPY	61.824	717,398.79	0.14
3,2800 % Banque Centrale de Tunisie YN-Bonds 2007(27) No.7	JP578801A785	%	1,100,000	JPY	72.829	4,648,062.97	0.92
0,8000 % Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2021(28) No. 17	JP396720CMC6	%	1,800,000	JPY	83.474	8,717,608.39	1.72
1,0500 % Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2021(31) No. 18	JP396720DMC4	%	700,000	JPY	71.658	2,910,288.03	0.57
7,5000 % Alb.Cos LLC/Safe.Inc/N.A.I./A. DL-Notes 2019(19/26) 144A	US013092AA91	%	9,000	USD	101.211	8,500,400.27	1.68
2,7180 % Sodexo Inc. DL-Bonds 2021(21/31)	US833794AB68	%	11,100	USD	85.151	8,820,268.36	1.74
1,9820 % UniCredit S.p.A. DL-FLR Pref. MTN 2021(26/27)	US904678AW97	%	19,094	USD	93.236	16,612,968.25	3.28
3,1270 % UniCredit S.p.A. DL-FLR Pref. MTN 2021(31/32)	US904678AY53	%	18,710	USD	85.110	14,860,082.43	2.93
6,8750 % Unisys Corp. DL-Notes 2020(20/27) 144A	US909214BV97	%	6,350	USD	87.742	5,199,325.37	1.03
Summe Wertpapiervermögen				EUR		442,782,368.18	87.36

XAIA Credit Basis II

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2024	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens *)
Derivate				EUR		-1,884,451.35	-0.37
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds				EUR		59,900,918.09	11.82
Bankguthaben				EUR		59,900,918.09	11.82
Guthaben bei Skandinaviska Enskilda Banken AB Stockholm Tagesgeld			2,136.11	CHF		2,218.87	0.00
Guthaben bei Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. Guthaben in Fondswährung (Cash Collateral)			400,000.00	EUR		400,000.00	0.08
Guthaben bei Bayerische Landesbank München Tagesgeld			48,000,000.00	EUR		48,000,000.00	9.47
Guthaben bei Landesbank Baden-Württemberg Stuttgart Tagesgeld			10,000,000.00	EUR		10,000,000.00	1.97
Guthaben bei SUMITOMO MITSUI TRUST BANK Ltd. GB Tagesgeld			1,152,072.04	EUR		1,152,072.04	0.23
			26,361,337.00	JPY		152,946.93	0.03
Guthaben bei Royal Bank of Canada London Tagesgeld			5,125.31	GBP		6,046.85	0.00
Guthaben bei Citibank N.A. New York Tagesgeld			201,067.95	USD		187,633.40	0.04

XAIA Credit Basis II

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2024	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens *)
Sonstige Vermögensgegenstände				EUR		11,881,454.60	2.34
Zinsansprüche			5,380,616.60	EUR		5,380,616.60	1.06
Zinsansprüche Swaps			6,471,692.56	EUR		6,471,692.56	1.28
Forderung aus Wertpapier-Pensionsgeschäft			10,539.00	EUR		10,539.00	0.00
Sonstige Forderungen			18,606.44	EUR		18,606.44	0.00
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme				EUR		-63,609.58	-0.01
Kredite bei Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. EUR-Kredite							
			-31,417.56	EUR		-31,417.56	-0.01
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen							
			-3,280,000.00	JPY		-19,030.37	0.00
			-14,104.02	USD		-13,161.65	0.00
Verbindlichkeiten				EUR		-5,771,503.61	-1.13
Zinsverbindlichkeiten Swaps			-5,302,407.70	EUR		-5,302,407.70	-1.05
Verwaltungsvergütung			-322,565.59	EUR		-322,565.59	-0.06
Verwahrstellenvergütung			-18,637.18	EUR		-18,637.18	0.00
Depotgebühren			-65,393.54	EUR		-65,393.54	-0.01
Prüfungs- und Veröffentlichungskosten			-40,350.00	EUR		-40,350.00	-0.01
Taxe d'abonnement			-14,570.57	EUR		-14,570.57	0.00
Sonstige Verbindlichkeiten			-7,579.03	EUR		-7,579.03	0.00
Teilfondsvermögen				EUR		506,845,176.34	100.00
XAIA Credit Basis II (I)							
Anteilwert				EUR		1,010.24	
Ausgabepreis				EUR		1,010.24	
Rücknahmepreis				EUR		1,010.24	
Anteile im Umlauf				STK		273,691.127	
XAIA Credit Basis II (P)							
Anteilwert				EUR		98.18	
Ausgabepreis				EUR		100.63	
Rücknahmepreis				EUR		98.18	
Anteile im Umlauf				STK		57,758.517	

XAIA Credit Basis II

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2024	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens *)
XAIA Credit Basis II (IT)							
Anteilwert				EUR		1,198.80	
Ausgabepreis				EUR		1,198.80	
Rücknahmepreis				EUR		1,198.80	
Anteile im Umlauf				STK		173,525.947	
XAIA Credit Basis II (R)							
Anteilwert				EUR		104.59	
Ausgabepreis				EUR		107.20	
Rücknahmepreis				EUR		104.59	
Anteile im Umlauf				STK		159,275.000	

*) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Devisentermingeschäfte zum 30.06.2024

	Währung	Betrag		Währung	Betrag	Fälligkeit	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Verkauf	CHF	-4,360,000.00	Kauf	EUR	4,503,315.77	05.07.2024	-28,001.83	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	GBP	-6,540,000.00	Kauf	EUR	7,681,993.65	05.07.2024	-31,753.86	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	JPY	-3,329,000,000.00	Kauf	EUR	19,678,588.18	05.07.2024	349,417.13	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	JPY	-26,200,000.00	Kauf	EUR	154,554.81	05.07.2024	2,429.76	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	JPY	-26,200,000.00	Kauf	EUR	154,573.05	05.07.2024	2,448.00	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Verkauf	USD	-366,000,000.00	Kauf	EUR	336,439,082.79	05.07.2024	-4,999,212.03	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
Verkauf	USD	-1,900,000.00	Kauf	EUR	1,764,149.87	05.07.2024	-8,344.01	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Verkauf	USD	-2,500,000.00	Kauf	EUR	2,324,422.00	05.07.2024	-7,806.79	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	USD	-5,450,000.00	Kauf	EUR	5,072,153.01	05.07.2024	-12,105.75	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	USD	-600,000.00	Kauf	EUR	558,788.61	05.07.2024	-946.30	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Summe Devisentermingeschäfte							-4,733,875.68	

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS030083207	13.04.2028			310,178.27	Goldman Sachs International Limited London
Floating Leg 13.04.18/13.04.28 EUR 3,906% (Floater)	4,300,000.00	EUR	3.9060 variabel		
Fixed Leg 13.04.18/13.04.28 EUR 0,8445% (Zinssatz fest)	-4,300,000.00	EUR	0.8445 fix		
SWAPIRS030088643	20.08.2026			217,138.30	Goldman Sachs International Limited London
Floating Leg 20.08.18/20.08.26 EUR 3,826% (Floater)	4,200,000.00	EUR	3.8260 variabel		
Fixed Leg 20.08.18/20.08.26 EUR 0,5865% (Zinssatz fest)	-4,200,000.00	EUR	0.5865 fix		
SWAPIRS030092105	23.10.2028			35,226.80	Goldman Sachs International Limited London
Floating Leg 23.10.18/23.10.28 JPY 0,04761% (Floater)	470,000,000.00	JPY	0.0476 variabel		
Fixed Leg 23.10.18/23.10.28 JPY 0,3775% (Zinssatz fest)	-470,000,000.00	JPY	0.3775 fix		
SWAPIRS107523	01.11.2024			82,776.36	J.P. Morgan SE Frankfurt
Floating Leg 01.11.19/01.11.24 EUR 3,835% (Floater)	6,000,000.00	EUR	3.8350 variabel		
Fixed Leg 01.11.19/01.11.24 EUR -0,307% (Zinssatz fest)	-6,000,000.00	EUR	-0.3070 fix		
SWAPIRS111916	10.03.2028			578,303.91	Deutsche Bank AG London
Floating Leg 10.03.20/10.03.28 USD 5,59605% (Floater)	5,000,000.00	USD	5.5961 variabel		
Fixed Leg 10.03.20/10.03.28 USD 0,771% (Zinssatz fest)	-5,000,000.00	USD	0.7710 fix		
SWAPIRS111918	10.03.2026			339,737.68	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 10.03.20/10.03.26 USD 5,59605% (Floater)	5,300,000.00	USD	5.5961 variabel		
Fixed Leg 10.03.20/10.03.26 USD 0,71% (Zinssatz fest)	-5,300,000.00	USD	0.7100 fix		
SWAPIRS114290	29.04.2026			721,507.53	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 29.04.20/29.04.26 USD 5,58648% (Floater)	10,100,000.00	USD	5.5865 variabel		
Fixed Leg 29.04.20/29.04.26 USD 0,5% (Zinssatz fest)	-10,100,000.00	USD	0.5000 fix		
SWAPIRS114493	12.05.2027			483,914.78	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 12.05.20/12.05.27 USD 5,58514% (Floater)	4,800,000.00	USD	5.5851 variabel		
Fixed Leg 12.05.20/12.05.27 USD 0,5275% (Zinssatz fest)	-4,800,000.00	USD	0.5275 fix		
SWAPIRS114495	12.05.2025			527,643.74	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 12.05.20/12.05.25 USD 5,58514% (Floater)	13,500,000.00	USD	5.5851 variabel		
Fixed Leg 12.05.20/12.05.25 USD 0,4035% (Zinssatz fest)	-13,500,000.00	USD	0.4035 fix		
SWAPIRS115264	01.06.2025			62,133.41	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 01.06.20/01.06.25 USD 5,60769% (Floater)	1,500,000.00	USD	5.6077 variabel		
Fixed Leg 01.06.20/01.06.25 USD 0,392% (Zinssatz fest)	-1,500,000.00	USD	0.3920 fix		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS115265	01.06.2026			261,726.29	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 01.06.20/01.06.26 USD 5,60769% (Floater)	3,500,000.00	USD	5.6077 variabel		
Fixed Leg 01.06.20/01.06.26 USD 0,46% (Zinssatz fest)	-3,500,000.00	USD	0.4600 fix		
SWAPIRS115274	02.06.2025			156,625.96	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 02.06.20/02.06.25 EUR 3,788% (Floater)	4,500,000.00	EUR	3.7880 variabel		
Fixed Leg 02.06.20/02.06.25 EUR -0,3525% (Zinssatz fest)	-4,500,000.00	EUR	-0.3525 fix		
SWAPIRS115735	16.06.2025			322,306.20	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 16.06.20/16.06.25 USD 5,60083% (Floater)	7,500,000.00	USD	5.6008 variabel		
Fixed Leg 16.06.20/16.06.25 USD 0,3835% (Zinssatz fest)	-7,500,000.00	USD	0.3835 fix		
SWAPIRS115736	16.06.2026			433,295.83	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 16.06.20/16.06.26 USD 5,60083% (Floater)	5,700,000.00	USD	5.6008 variabel		
Fixed Leg 16.06.20/16.06.26 USD 0,4575% (Zinssatz fest)	-5,700,000.00	USD	0.4575 fix		
SWAPIRS115739	16.06.2029			589,218.16	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 16.06.20/16.06.29 USD 5,60083% (Floater)	3,900,000.00	USD	5.6008 variabel		
Fixed Leg 16.06.20/16.06.29 USD 0,6475% (Zinssatz fest)	-3,900,000.00	USD	0.6475 fix		
SWAPIRS115740	16.06.2032			278,226.21	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 16.06.20/16.06.32 USD 5,60083% (Floater)	1,300,000.00	USD	5.6008 variabel		
Fixed Leg 16.06.20/16.06.32 USD 0,7795% (Zinssatz fest)	-1,300,000.00	USD	0.7795 fix		
SWAPIRS117979	12.08.2027			828,753.63	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 12.08.20/12.08.27 USD 5,58514% (Floater)	7,500,000.00	USD	5.5851 variabel		
Fixed Leg 12.08.20/12.08.27 USD 0,423% (Zinssatz fest)	-7,500,000.00	USD	0.4230 fix		
SWAPIRS117980	12.08.2025			547,805.26	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 12.08.20/12.08.25 USD 5,58514% (Floater)	11,000,000.00	USD	5.5851 variabel		
Fixed Leg 12.08.20/12.08.25 USD 0,299% (Zinssatz fest)	-11,000,000.00	USD	0.2990 fix		
SWAPIRS118375	28.08.2025			99,467.26	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 28.08.20/28.08.25 EUR 3,808% (Floater)	2,300,000.00	EUR	3.8080 variabel		
Fixed Leg 28.08.20/28.08.25 EUR -0,415% (Zinssatz fest)	-2,300,000.00	EUR	-0.4150 fix		
SWAPIRS118517	02.09.2026			249,966.47	Deutsche Bank AG London
Floating Leg 02.09.20/02.09.26 USD 5,60769% (Floater)	3,000,000.00	USD	5.6077 variabel		
Fixed Leg 02.09.20/02.09.26 USD 0,42% (Zinssatz fest)	-3,000,000.00	USD	0.4200 fix		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS118518	02.09.2029			421,256.75	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 02.09.20/02.09.29 USD 5,60769% (Floater)	2,700,000.00	USD	5.6077 variabel		
Fixed Leg 02.09.20/02.09.29 USD 0,65625% (Zinssatz fest)	-2,700,000.00	USD	0.6563 fix		
SWAPIRS121604	28.01.2025			95,636.88	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 28.01.21/28.01.25 EUR 3,864% (Floater)	4,000,000.00	EUR	3.8640 variabel		
Fixed Leg 28.01.21/28.01.25 EUR -0,512% (Zinssatz fest)	-4,000,000.00	EUR	-0.5120 fix		
SWAPIRS121608	28.01.2031			670,136.92	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 28.01.21/28.01.31 USD 5,58648% (Floater)	4,000,000.00	USD	5.5865 variabel		
Fixed Leg 28.01.21/28.01.31 USD 1,073% (Zinssatz fest)	-4,000,000.00	USD	1.0730 fix		
SWAPIRS122555	24.02.2025			244,541.75	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 24.02.21/24.02.25 USD 5,59246% (Floater)	8,200,000.00	USD	5.5925 variabel		
Fixed Leg 24.02.21/24.02.25 USD 0,5225% (Zinssatz fest)	-8,200,000.00	USD	0.5225 fix		
SWAPIRS127144	10.06.2028			223,345.91	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 10.06.21/10.06.28 EUR 3,755% (Floater)	2,000,000.00	EUR	3.7550 variabel		
Fixed Leg 10.06.21/10.06.28 EUR -0,167% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	EUR	-0.1670 fix		
SWAPIRS127145	10.06.2033			403,900.61	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 10.06.21/10.06.33 USD 5,59605% (Floater)	2,300,000.00	USD	5.5961 variabel		
Fixed Leg 10.06.21/10.06.33 USD 1,64% (Zinssatz fest)	-2,300,000.00	USD	1.6400 fix		
SWAPIRS129685	30.09.2026			283,390.20	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 30.09.21/30.09.26 EUR 3,722% (Floater)	4,000,000.00	EUR	3.7220 variabel		
Fixed Leg 30.09.21/30.09.26 EUR -0,217% (Zinssatz fest)	-4,000,000.00	EUR	-0.2170 fix		
SWAPIRS130877	11.11.2028			94,750.63	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 11.11.21/11.11.28 EUR 3,806% (Floater)	800,000.00	EUR	3.8060 variabel		
Fixed Leg 11.11.21/11.11.28 EUR -0,08% (Zinssatz fest)	-800,000.00	EUR	-0.0800 fix		
SWAPIRS133885	24.02.2028			376,644.33	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 24.02.22/24.02.28 USD 5,31714% (Floater)	4,800,000.00	USD	5.3166 variabel		
Fixed Leg 24.02.22/24.02.28 USD 1,6561% (Zinssatz fest)	-4,800,000.00	USD	1.6561 fix		
SWAPIRS135780	04.04.2029			75,418.63	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 04.04.22/04.04.29 USD 5,31786% (Floater)	1,000,000.00	USD	5.3170 variabel		
Fixed Leg 04.04.22/04.04.29 USD 2,145% (Zinssatz fest)	-1,000,000.00	USD	2.1450 fix		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS136633	29.04.2027			133,958.42	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 29.04.22/29.04.27 EUR 3,864% (Floater)	2,800,000.00	EUR	3.8640 variabel		
Fixed Leg 29.04.22/29.04.27 EUR 1,207% (Zinssatz fest)	-2,800,000.00	EUR	1.2070 fix		
SWAPIRS142254	05.08.2030			66,559.19	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 05.08.22/05.08.30 EUR 3,853% (Floater)	1,000,000.00	EUR	3.8530 variabel		
Fixed Leg 05.08.22/05.08.30 EUR 1,58% (Zinssatz fest)	-1,000,000.00	EUR	1.5800 fix		
SWAPIRS142666	18.08.2026			175,459.23	Deutsche Bank AG London
Floating Leg 18.08.22/18.08.26 EUR 3,826% (Floater)	5,000,000.00	EUR	3.8260 variabel		
Fixed Leg 18.08.22/18.08.26 EUR 1,398% (Zinssatz fest)	-5,000,000.00	EUR	1.3980 fix		
SWAPIRS146124	28.10.2027			8,780.21	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 28.10.22/28.10.27 EUR 3,864% (Floater)	3,000,000.00	EUR	3.8640 variabel		
Fixed Leg 28.10.22/28.10.27 EUR 2,843% (Zinssatz fest)	-3,000,000.00	EUR	2.8430 fix		
SWAPIRS146919	21.11.2032			320,443.32	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 21.11.22/21.11.32 USD 5,31946% (Floater)	10,500,000.00	USD	5.3192 variabel		
Fixed Leg 21.11.22/21.11.32 USD 3,427% (Zinssatz fest)	-10,500,000.00	USD	3.4270 fix		
SWAPIRS146920	21.11.2028			51,023.08	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 21.11.22/21.11.28 USD 5,31946% (Floater)	3,000,000.00	USD	5.3192 variabel		
Fixed Leg 21.11.22/21.11.28 USD 3,612% (Zinssatz fest)	-3,000,000.00	USD	3.6120 fix		
SWAPIRS147124	23.11.2027			26,662.18	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 23.11.22/23.11.27 EUR 3,823% (Floater)	3,000,000.00	EUR	3.8230 variabel		
Fixed Leg 23.11.22/23.11.27 EUR 2,653% (Zinssatz fest)	-3,000,000.00	EUR	2.6530 fix		
SWAPIRS147128	23.11.2031			66,229.83	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 23.11.22/23.11.31 USD 5,31949% (Floater)	2,800,000.00	USD	5.3192 variabel		
Fixed Leg 23.11.22/23.11.31 USD 3,509% (Zinssatz fest)	-2,800,000.00	USD	3.5090 fix		
SWAPIRS147261	30.11.2028			67,619.48	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 30.11.22/30.11.28 USD 5,31848% (Floater)	3,500,000.00	USD	5.3182 variabel		
Fixed Leg 30.11.22/30.11.28 USD 3,55% (Zinssatz fest)	-3,500,000.00	USD	3.5500 fix		
SWAPIRS147264	30.11.2032			16,875.37	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 30.11.22/30.11.32 USD 5,31848% (Floater)	500,000.00	USD	5.3182 variabel		
Fixed Leg 30.11.22/30.11.32 USD 3,379% (Zinssatz fest)	-500,000.00	USD	3.3790 fix		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS147316	05.12.2027			125,721.71	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 05.12.22/05.12.27 USD 5,31816% (Floater)	6,000,000.00	USD	5.3178 variabel		
Fixed Leg 05.12.22/05.12.27 USD 3,493% (Zinssatz fest)	-6,000,000.00	USD	3.4930 fix		
SWAPIRS147319	05.12.2030			48,086.32	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 05.12.22/05.12.30 USD 5,31816% (Floater)	1,500,000.00	USD	5.3178 variabel		
Fixed Leg 05.12.22/05.12.30 USD 3,326% (Zinssatz fest)	-1,500,000.00	USD	3.3260 fix		
SWAPIRS147320	05.12.2028			112,820.99	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 05.12.22/05.12.28 USD 5,31816% (Floater)	4,600,000.00	USD	5.3178 variabel		
Fixed Leg 05.12.22/05.12.28 USD 3,411% (Zinssatz fest)	-4,600,000.00	USD	3.4110 fix		
SWAPIRS147375	06.12.2028			123,365.63	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 06.12.22/06.12.28 USD 5,31816% (Floater)	4,500,000.00	USD	5.3178 variabel		
Fixed Leg 06.12.22/06.12.28 USD 3,334% (Zinssatz fest)	-4,500,000.00	USD	3.3340 fix		
SWAPIRS148240	21.12.2030			103,861.84	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 21.12.22/21.12.30 USD 3,28% (Floater)	3,000,000.00	USD	5.3181 variabel		
Fixed Leg 21.12.22/21.12.30 USD 3,28% (Zinssatz fest)	-3,000,000.00	USD	3.2800 fix		
SWAPIRS148559	13.01.2030			59,737.71	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 13.01.23/13.01.30 USD 5,31554% (Floater)	1,900,000.00	USD	5.3151 variabel		
Fixed Leg 13.01.23/13.01.30 USD 3,2939% (Zinssatz fest)	-1,900,000.00	USD	3.2939 fix		
SWAPIRS148561	13.01.2032			116,541.49	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 13.01.23/13.01.32 USD 5,31554% (Floater)	3,000,000.00	USD	5.3151 variabel		
Fixed Leg 13.01.23/13.01.32 USD 3,26% (Zinssatz fest)	-3,000,000.00	USD	3.2600 fix		
SWAPIRS148685	20.01.2028			174,580.73	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 20.01.23/20.01.28 USD 5,31565% (Floater)	6,200,000.00	USD	5.3152 variabel		
Fixed Leg 20.01.23/20.01.28 USD 3,2595% (Zinssatz fest)	-6,200,000.00	USD	3.2595 fix		
SWAPIRS148687	20.01.2033			61,179.80	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 20.01.23/20.01.33 USD 5,31565% (Floater)	1,200,000.00	USD	5.3152 variabel		
Fixed Leg 20.01.23/20.01.33 USD 3,128% (Zinssatz fest)	-1,200,000.00	USD	3.1280 fix		
SWAPIRS148688	20.01.2035			159,320.31	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 20.01.23/20.01.35 USD 5,31565% (Floater)	2,700,000.00	USD	5.3152 variabel		
Fixed Leg 20.01.23/20.01.35 USD 3,136% (Zinssatz fest)	-2,700,000.00	USD	3.1360 fix		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS148822	31.01.2030			107,978.08	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 31.01.23/31.01.30 USD 5,31567% (Floater)	3,500,000.00	USD	5.3152 variabel		
Fixed Leg 31.01.23/31.01.30 USD 3,309% (Zinssatz fest)	-3,500,000.00	USD	3.3090 fix		
SWAPIRS148823	31.01.2031			92,001.28	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 31.01.23/31.01.31 USD 5,31567% (Floater)	2,600,000.00	USD	5.3152 variabel		
Fixed Leg 31.01.23/31.01.31 USD 3,271% (Zinssatz fest)	-2,600,000.00	USD	3.2710 fix		
SWAPIRS148840	01.02.2029			70,468.18	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 01.02.23/01.02.29 USD 5,31558% (Floater)	2,700,000.00	USD	5.3151 variabel		
Fixed Leg 01.02.23/01.02.29 USD 3,3755% (Zinssatz fest)	-2,700,000.00	USD	3.3755 fix		
SWAPIRS149167	09.02.2034			43,214.75	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 09.02.23/09.02.34 USD 5,31573% (Floater)	1,100,000.00	USD	5.3152 variabel		
Fixed Leg 09.02.23/09.02.34 USD 3,346% (Zinssatz fest)	-1,100,000.00	USD	3.3460 fix		
SWAPIRS152258	17.04.2026			40,536.76	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 17.04.23/17.04.26 USD 5,31904% (Floater)	2,400,000.00	USD	5.3181 variabel		
Fixed Leg 17.04.23/17.04.26 USD 3,589% (Zinssatz fest)	-2,400,000.00	USD	3.5890 fix		
SWAPIRS152260	17.04.2027			80,860.45	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 17.04.23/17.04.27 USD 5,31904% (Floater)	3,500,000.00	USD	5.3181 variabel		
Fixed Leg 17.04.23/17.04.27 USD 3,379% (Zinssatz fest)	-3,500,000.00	USD	3.3790 fix		
SWAPIRS152263	17.04.2033			108,683.88	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 17.04.23/17.04.33 USD 5,31904% (Floater)	2,100,000.00	USD	5.3181 variabel		
Fixed Leg 17.04.23/17.04.33 USD 3,13% (Zinssatz fest)	-2,100,000.00	USD	3.1300 fix		
SWAPIRS152264	17.04.2029			126,615.84	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 17.04.23/17.04.29 USD 5,31904% (Floater)	3,800,000.00	USD	5.3181 variabel		
Fixed Leg 17.04.23/17.04.29 USD 3,2% (Zinssatz fest)	-3,800,000.00	USD	3.2000 fix		
SWAPIRS153014	19.05.2032			75,257.00	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 19.05.23/19.05.32 USD 5,32429% (Floater)	1,800,000.00	USD	5.3231 variabel		
Fixed Leg 19.05.23/19.05.32 USD 3,227% (Zinssatz fest)	-1,800,000.00	USD	3.2270 fix		
SWAPIRS153106	24.05.2033			85,458.03	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 24.05.23/24.05.33 USD 5,32629% (Floater)	2,700,000.00	USD	5.3250 variabel		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS153111	25.05.2030			84,949.47	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 25.05.23/25.05.30 USD 5,32629% (Floater)	3,700,000.00	USD	5.3250 variabel		
Fixed Leg 25.05.23/25.05.30 USD 3,4825% (Zinssatz fest)	-3,700,000.00	USD	3.4825 fix		
SWAPIRS153337	07.06.2030			72,773.95	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 07.06.23/07.06.30 USD 5,32333% (Floater)	4,000,000.00	USD	5.3210 variabel		
Fixed Leg 07.06.23/07.06.30 USD 3,58% (Zinssatz fest)	-4,000,000.00	USD	3.5800 fix		
SWAPIRS153431	15.06.2028			99,010.11	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 15.06.23/15.06.28 USD 5,32714% (Floater)	6,500,000.00	USD	5.3236 variabel		
Fixed Leg 15.06.23/15.06.28 USD 3,6585% (Zinssatz fest)	-6,500,000.00	USD	3.6585 fix		
SWAPIRS153433	15.06.2033			17,768.34	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 15.06.23/15.06.33 USD 5,32714% (Floater)	600,000.00	USD	5.3236 variabel		
Fixed Leg 15.06.23/15.06.33 USD 3,454% (Zinssatz fest)	-600,000.00	USD	3.4540 fix		
SWAPIRS153435	15.06.2028			-5,627.96	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 15.06.23/15.06.28 EUR 3,719% (Floater)	1,000,000.00	EUR	3.7190 variabel		
Fixed Leg 15.06.23/15.06.28 EUR 3,02% (Zinssatz fest)	-1,000,000.00	EUR	3.0200 fix		
SWAPIRS153493	20.06.2033			50,764.57	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 20.06.23/20.06.33 USD 5,32636% (Floater)	2,250,000.00	USD	5.3213 variabel		
Fixed Leg 20.06.23/20.06.33 USD 3,555% (Zinssatz fest)	-2,250,000.00	USD	3.5550 fix		
SWAPIRS153494	20.06.2027			21,211.65	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 20.06.23/20.06.27 USD 5,32636% (Floater)	2,000,000.00	USD	5.3213 variabel		
Fixed Leg 20.06.23/20.06.27 USD 3,8625% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	USD	3.8625 fix		
SWAPIRS153542	22.06.2033			71,856.73	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 22.06.23/22.06.33 USD 5,34% (Floater)	2,450,000.00	USD	5.3400 variabel		
Fixed Leg 22.06.23/22.06.33 USD 3,4583% (Zinssatz fest)	-2,450,000.00	USD	3.4583 fix		
SWAPIRS153654	28.06.2026			30,346.80	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 28.06.23/28.06.26 USD 5,34% (Floater)	4,400,000.00	USD	5.2950 variabel		
Fixed Leg 28.06.23/28.06.26 USD 4,153% (Zinssatz fest)	-4,400,000.00	USD	4.1530 fix		
SWAPIRS153946	10.07.2026			462.09	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 10.07.23/10.07.26 USD 5,30305% (Floater)	2,200,000.00	USD	5.3027 variabel		
Fixed Leg 10.07.23/10.07.26 USD 4,523% (Zinssatz fest)	-2,200,000.00	USD	4.5230 fix		
SWAPIRS154057	11.07.2028			741.05	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
Floating Leg 11.07.23/11.07.28 USD 5,30374% (Floater)	3,200,000.00	USD	5.2535 variabel		
Fixed Leg 11.07.23/11.07.28 USD 4,0925% (Zinssatz fest)	-3,200,000.00	USD	4.0925 fix		
SWAPIRS154058	11.07.2033			17,400.43	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 11.07.23/11.07.33 USD 5,30374% (Floater)	2,900,000.00	USD	5.2535 variabel		
Fixed Leg 11.07.23/11.07.33 USD 3,79125% (Zinssatz fest)	-2,900,000.00	USD	3.7913 fix		
SWAPIRS154115	11.07.2028			-53,635.55	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 11.07.23/11.07.28 EUR 3,928% (Floater)	2,800,000.00	EUR	3.9280 variabel		
Fixed Leg 11.07.23/11.07.28 EUR 3,373% (Zinssatz fest)	-2,800,000.00	EUR	3.3730 fix		
SWAPIRS154116	13.07.2030			18,107.35	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 13.07.23/13.07.30 USD 5,30514% (Floater)	2,900,000.00	USD	5.3048 variabel		
Fixed Leg 13.07.23/13.07.30 USD 3,821% (Zinssatz fest)	-2,900,000.00	USD	3.8210 fix		
SWAPIRS154201	17.07.2031			117,561.32	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 17.07.23/17.07.31 USD 5,30803% (Floater)	6,500,000.00	USD	5.3078 variabel		
Fixed Leg 17.07.23/17.07.31 USD 3,5937% (Zinssatz fest)	-6,500,000.00	USD	3.5937 fix		
SWAPIRS154253	20.07.2027			20,847.05	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 20.07.23/20.07.27 JPY (Floater)	440,000,000.00	JPY	variabel		
Fixed Leg 20.07.23/20.07.27 JPY 0,2585% (Zinssatz fest)	-440,000,000.00	JPY	0.2585 fix		
SWAPIRS154254	20.07.2029			15,767.81	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 20.07.23/20.07.29 JPY (Floater)	220,000,000.00	JPY	variabel		
Fixed Leg 20.07.23/20.07.29 JPY 0,42875% (Zinssatz fest)	-220,000,000.00	JPY	0.4288 fix		
SWAPIRS154259	21.07.2030			13,522.69	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 21.07.23/21.07.30 JPY (Floater)	145,000,000.00	JPY	variabel		
Fixed Leg 21.07.23/21.07.30 JPY 0,481% (Zinssatz fest)	-145,000,000.00	JPY	0.4810 fix		
SWAPIRS154300	25.07.2028			3,993.25	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 25.07.23/25.07.28 JPY (Floater)	50,000,000.00	JPY	variabel		
Fixed Leg 25.07.23/25.07.28 JPY 0,264% (Zinssatz fest)	-50,000,000.00	JPY	0.2640 fix		
SWAPIRS154419	01.08.2026			11,945.40	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 01.08.23/01.08.26 JPY (Floater)	400,000,000.00	JPY	variabel		
Fixed Leg 01.08.23/01.08.26 JPY 0,1835% (Zinssatz fest)	-400,000,000.00	JPY	0.1835 fix		
SWAPIRS154517	02.08.2028			13,592.08	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 02.08.23/02.08.28 JPY (Floater)	250,000,000.00	JPY	variabel		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
Fixed Leg 02.08.23/02.08.28 JPY 0,376% (Zinssatz fest)	-250,000,000.00	JPY	0.3760 fix		
SWAPIRS154848	14.08.2032			11,510.23	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 14.08.23/14.08.32 USD 5,31624% (Floater)	1,300,000.00	USD	5.3160 variabel		
Fixed Leg 14.08.23/14.08.32 USD 3,752% (Zinssatz fest)	-1,300,000.00	USD	3.7520 fix		
SWAPIRS156268	08.09.2033			-33,331.02	BNP Paribas S.A. Frankfurt
Floating Leg 08.09.23/08.09.33 USD 5,31737% (Floater)	3,900,000.00	USD	5.3171 variabel		
Fixed Leg 08.09.23/08.09.33 USD 3,9973% (Zinssatz fest)	-3,900,000.00	USD	3.9973 fix		
SWAPIRS156684	21.09.2028			3,998.00	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 21.09.23/21.09.28 JPY (Floater)	200,000,000.00	JPY	variabel		
Fixed Leg 21.09.23/21.09.28 JPY 0,535% (Zinssatz fest)	-200,000,000.00	JPY	0.5350 fix		
SWAPIRS156686	21.09.2031			2,473.06	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 21.09.23/21.09.31 JPY (Floater)	105,000,000.00	JPY	variabel		
Fixed Leg 21.09.23/21.09.31 JPY 0,78625% (Zinssatz fest)	-105,000,000.00	JPY	0.7863 fix		
SWAPIRS156809	25.09.2026			-12,399.22	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 25.09.23/25.09.26 USD 5,31825% (Floater)	2,700,000.00	USD	5.3180 variabel		
Fixed Leg 25.09.23/25.09.26 USD 4,72% (Zinssatz fest)	-2,700,000.00	USD	4.7200 fix		
SWAPIRS157232	27.09.2026			-9,703.70	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 27.09.23/27.09.26 USD 5,31831% (Floater)	2,500,000.00	USD	5.3181 variabel		
Fixed Leg 27.09.23/27.09.26 USD 4,681% (Zinssatz fest)	-2,500,000.00	USD	4.6810 fix		
SWAPIRS157356	03.10.2025			-15,949.61	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 03.10.23/03.10.25 CHF (Floater)	2,300,000.00	CHF	variabel		
Fixed Leg 03.10.23/03.10.25 CHF 1,71% (Zinssatz fest)	-2,300,000.00	CHF	1.7100 fix		
SWAPIRS158158	16.10.2027			-60,462.97	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 16.10.23/16.10.27 USD 5,31869% (Floater)	7,200,000.00	USD	5.3184 variabel		
Fixed Leg 16.10.23/16.10.27 USD 4,52% (Zinssatz fest)	-7,200,000.00	USD	4.5200 fix		
SWAPIRS158896	24.10.2032			-145,054.77	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 24.10.23/24.10.32 USD 5,3192% (Floater)	3,000,000.00	USD	5.3190 variabel		
Fixed Leg 24.10.23/24.10.32 USD 4,626% (Zinssatz fest)	-3,000,000.00	USD	4.6260 fix		
SWAPIRS158899	20.10.2027			-18,748.22	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 20.10.23/20.10.27 USD 5,3189% (Floater)	1,300,000.00	USD	5.3187 variabel		
Fixed Leg 20.10.23/20.10.27 USD 4,7304% (Zinssatz fest)	-1,300,000.00	USD	4.7304 fix		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS158904	27.10.2027			-43,883.72	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 27.10.23/27.10.27 USD 5,3194% (Floater)	3,500,000.00	USD	5.3191 variabel		
Fixed Leg 27.10.23/27.10.27 USD 4,659% (Zinssatz fest)	-3,500,000.00	USD	4.6590 fix		
SWAPIRS159869	09.11.2026			-8,171.64	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 09.11.23/09.11.26 USD 5,31936% (Floater)	7,500,000.00	USD	5.3191 variabel		
Fixed Leg 09.11.23/09.11.26 USD 4,5075% (Zinssatz fest)	-7,500,000.00	USD	4.5075 fix		
SWAPIRS160165	17.11.2026			-328.68	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 17.11.23/17.11.26 USD 5,31934% (Floater)	9,500,000.00	USD	5.3191 variabel		
Fixed Leg 17.11.23/17.11.26 USD 4,4505% (Zinssatz fest)	-9,500,000.00	USD	4.4505 fix		
SWAPIRS160167	17.11.2028			-7,838.42	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 17.11.23/17.11.28 USD 5,31934% (Floater)	1,200,000.00	USD	5.3191 variabel		
Fixed Leg 17.11.23/17.11.28 USD 4,248% (Zinssatz fest)	-1,200,000.00	USD	4.2480 fix		
SWAPIRS160168	17.11.2029			-20,562.26	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 17.11.23/17.11.29 USD 5,31934% (Floater)	2,000,000.00	USD	5.3191 variabel		
Fixed Leg 17.11.23/17.11.29 USD 4,218% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	USD	4.2180 fix		
SWAPIRS160175	17.11.2029			-105,494.10	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 17.11.23/17.11.29 USD 5,31934% (Floater)	10,000,000.00	USD	5.3191 variabel		
Fixed Leg 17.11.23/17.11.29 USD 4,224% (Zinssatz fest)	-10,000,000.00	USD	4.2240 fix		
SWAPIRS160466	29.11.2025			8,583.43	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 29.11.23/29.11.25 USD 5,31949% (Floater)	6,000,000.00	USD	5.3192 variabel		
Fixed Leg 29.11.23/29.11.25 USD 4,732% (Zinssatz fest)	-6,000,000.00	USD	4.7320 fix		
SWAPIRS160642	04.12.2030			4,088.21	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 04.12.23/04.12.30 USD 5,31848% (Floater)	2,900,000.00	USD	5.3182 variabel		
Fixed Leg 04.12.23/04.12.30 USD 3,911% (Zinssatz fest)	-2,900,000.00	USD	3.9110 fix		
SWAPIRS160825	11.12.2026			28,587.02	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 11.12.23/11.12.26 USD (Floater)	3,800,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 11.12.23/11.12.26 USD 4,0794% (Zinssatz fest)	-3,800,000.00	USD	4.0794 fix		
SWAPIRS162742	12.01.2031			62,773.42	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 12.01.24/12.01.31 USD (Floater)	4,000,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 12.01.24/12.01.31 USD 3,639% (Zinssatz fest)	-4,000,000.00	USD	3.6390 fix		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS162743	10.01.2029			118,986.13	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 10.01.24/10.01.29 GBP (Floater)	6,400,000.00	GBP	variabel		
Fixed Leg 10.01.24/10.01.29 GBP 3,663% (Zinssatz fest)	-6,400,000.00	GBP	3.6630 fix		
SWAPIRS162784	15.01.2032			17,007.39	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 15.01.24/15.01.32 JPY (Floater)	190,000,000.00	JPY	variabel		
Fixed Leg 15.01.24/15.01.32 JPY 0,658% (Zinssatz fest)	-190,000,000.00	JPY	0.6580 fix		
SWAPIRS162829	18.01.2026			115,421.40	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 18.01.24/18.01.26 USD 5,31552% (Floater)	11,000,000.00	USD	5.3151 variabel		
Fixed Leg 18.01.24/18.01.26 USD 4,017% (Zinssatz fest)	-11,000,000.00	USD	4.0170 fix		
SWAPIRS162830	18.01.2028			26,361.93	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 18.01.24/18.01.28 USD 5,31552% (Floater)	1,700,000.00	USD	5.3151 variabel		
Fixed Leg 18.01.24/18.01.28 USD 3,675% (Zinssatz fest)	-1,700,000.00	USD	3.6750 fix		
SWAPIRS163142	01.02.2028			9,451.81	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 01.02.24/01.02.28 JPY (Floater)	320,000,000.00	JPY	variabel		
Fixed Leg 01.02.24/01.02.28 JPY 0,42625% (Zinssatz fest)	-320,000,000.00	JPY	0.4263 fix		
SWAPIRS163809	19.02.2028			28,006.08	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 19.02.24/19.02.28 EUR 3,826% (Floater)	3,700,000.00	EUR	3.8260 variabel		
Fixed Leg 19.02.24/19.02.28 EUR 2,686% (Zinssatz fest)	-3,700,000.00	EUR	2.6860 fix		
SWAPIRS163914	20.02.2027			26,006.36	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 20.02.24/20.02.27 USD 5,31659% (Floater)	6,000,000.00	USD	5.3161 variabel		
Fixed Leg 20.02.24/20.02.27 USD 4,186% (Zinssatz fest)	-6,000,000.00	USD	4.1860 fix		
SWAPIRS164406	07.03.2031			11,382.01	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 07.03.24/07.03.31 USD (Floater)	2,800,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 07.03.24/07.03.31 USD 3,853% (Zinssatz fest)	-2,800,000.00	USD	3.8530 fix		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS164407	07.03.2033			14,868.58	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 07.03.24/07.03.33 USD (Floater)	3,200,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 07.03.24/07.03.33 USD 3,816% (Zinssatz fest)	-3,200,000.00	USD	3.8160 fix		
SWAPIRS164412	07.03.2033			30,564.52	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 07.03.24/07.03.33 USD (Floater)	4,000,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 07.03.24/07.03.33 USD 3,772% (Zinssatz fest)	-4,000,000.00	USD	3.7720 fix		
SWAPIRS164783	14.03.2031			44,494.52	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 14.03.24/14.03.31 USD (Floater)	5,800,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 14.03.24/14.03.31 USD 3,786% (Zinssatz fest)	-5,800,000.00	USD	3.7860 fix		
SWAPIRS164851	18.03.2031			-14,877.19	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 18.03.24/18.03.31 USD 5,31% (Floater)	9,000,000.00	USD	5.3100 variabel		
Fixed Leg 18.03.24/18.03.31 USD 3,957% (Zinssatz fest)	-9,000,000.00	USD	3.9570 fix		
SWAPIRS164853	19.03.2031			-2,107.52	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 19.03.24/19.03.31 USD 5,31856% (Floater)	1,800,000.00	USD	5.3179 variabel		
Fixed Leg 19.03.24/19.03.31 USD 3,948% (Zinssatz fest)	-1,800,000.00	USD	3.9480 fix		
SWAPIRS165001	26.03.2026			7,799.57	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 26.03.24/26.03.26 USD 5,31918% (Floater)	2,800,000.00	USD	5.3185 variabel		
Fixed Leg 26.03.24/26.03.26 USD 4,501% (Zinssatz fest)	-2,800,000.00	USD	4.5010 fix		
SWAPIRS165651	05.04.2026			2,032.45	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 05.04.24/05.04.26 USD (Floater)	3,200,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 05.04.24/05.04.26 USD 4,6258% (Zinssatz fest)	-3,200,000.00	USD	4.6258 fix		
SWAPIRS167105	10.05.2027			-9,904.37	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 10.05.24/10.05.27 USD (Floater)	2,000,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 10.05.24/10.05.27 USD 4,509% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	USD	4.5090 fix		
SWAPIRS167106	10.05.2031			-22,055.36	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 10.05.24/10.05.31 USD 5,32154% (Floater)	1,700,000.00	USD	5.3204 variabel		
Fixed Leg 10.05.24/10.05.31 USD 4,153% (Zinssatz fest)	-1,700,000.00	USD	4.1530 fix		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit		Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
	Nominale 1	Nominale 2				
Zinsswaps						
SWAPIRS167565		13.06.2032			-46,809.00	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 13.06.24/13.06.32 USD (Floater)	3,800,000.00		USD	variabel		
Fixed Leg 13.06.24/13.06.32 USD 4,086% (Zinssatz fest)	-3,800,000.00		USD	4.0860 fix		
SWAPIRS167570		13.06.2026			-7,598.77	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 13.06.24/13.06.26 USD (Floater)	2,800,000.00		USD	variabel		
Fixed Leg 13.06.24/13.06.26 USD 4,7208% (Zinssatz fest)	-2,800,000.00		USD	4.7208 fix		
Zinsswaps gesamt					13,477,349.96	

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS030079606	20.12.2027			419,932.81	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.06.19/20.12.27 USD Banque Centrale de Tunisie DL-Notes 1997(27)	4,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.19/20.12.27 USD 1%	-4,000,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS030079851	20.12.2027			524,916.01	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.06.19/20.12.27 USD Banque Centrale de Tunisie DL-Notes 1997(27)	5,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.19/20.12.27 USD 1%	-5,000,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS030085311	20.06.2028			22,032.80	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.06.19/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	154,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.19/20.06.28 JPY 1%	-154,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS030085934	20.06.2028			5,508.20	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.06.19/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	38,500,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.19/20.06.28 JPY 1%	-38,500,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS030086903	20.06.2028			17,883.76	Goldman Sachs International Limited London
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	125,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-125,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS030087004	20.06.2028			35,767.52	Goldman Sachs International Limited London
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	250,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-250,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS030087008	20.06.2028			26,825.64	Goldman Sachs International Limited London
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	187,500,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-187,500,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS030087307	20.06.2028			31,296.58	Goldman Sachs International Limited London
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	218,750,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-218,750,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS030087308	20.06.2028			35,767.52	Goldman Sachs International Limited London
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	250,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-250,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS030087404	20.06.2028			37,656.05	Goldman Sachs International Limited London
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	263,200,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-263,200,000.00	JPY	1.0000		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS030087815 CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44 CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 327,500,000.00 -327,500,000.00	JPY JPY	1.0000	46,855.46	Goldman Sachs International Limited London
SWAPCDS030087832 CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44 CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 196,500,000.00 -196,500,000.00	JPY JPY	1.0000	28,113.27	Goldman Sachs International Limited London
SWAPCDS030088624 CDS Reference Asset 20.06.19/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44 CDS Gebührenleg 20.06.19/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 127,500,000.00 -127,500,000.00	JPY JPY	1.0000	18,241.44	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS113619 CDS Reference Asset 20.03.20/20.12.25 USD Pactiv LLC DL-Notes 1999(25) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.12.25 USD 5%	20.12.2025 5,000,000.00 -5,000,000.00	USD USD	5.0000	-333,167.50	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS113620 CDS Reference Asset 20.03.20/20.12.25 USD Pactiv LLC DL-Notes 1999(25) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.12.25 USD 5%	20.12.2025 500,000.00 -500,000.00	USD USD	5.0000	-33,316.75	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS114404 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Level 3 Financing Inc. DL-Notes 2015(15/22) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 2,550,000.00 -2,550,000.00	USD USD	5.0000	-107,191.73	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS114712 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.27 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.27 USD 1%	20.06.2027 300,000.00 -300,000.00	USD USD	1.0000	-1,928.60	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS116343 CDS Reference Asset 22.06.20/20.09.29 USD New Albertsons L.P. DL-Notes 2001(01/31) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.09.29 USD 5%	20.09.2029 3,500,000.00 -3,500,000.00	USD USD	5.0000	-694,283.13	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS116345 CDS Reference Asset 22.06.20/20.09.27 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.09.27 USD 5%	20.09.2027 1,500,000.00 -1,500,000.00	USD USD	5.0000	-203,480.07	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Kupon	Unrealisiertes Ergebnis	Gegenpartei
	Nominale 1	Whg 2	in %	in EUR	
	Nominale 2				
Credit Default Swaps					
SWAPCDS116932	20.03.2026			-67,327.77	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Ovintiv Inc. DL-Notes 2015(15/26)	5,150,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 1%	-5,150,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS116957	20.06.2028			96,400.63	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 22.06.20/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	673,800,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 22.06.20/20.06.28 JPY 1%	-673,800,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS118127	20.03.2026			-225,670.93	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Ovintiv Inc. DL-Notes 2015(15/26)	3,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	-3,000,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS118349	20.03.2026			-145,754.94	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31)	1,900,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	-1,900,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS118352	20.03.2026			-145,754.94	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31)	1,900,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	-1,900,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS118648	20.03.2026			-145,754.94	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31)	1,900,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	-1,900,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS118649	20.03.2026			-218,632.41	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31)	2,850,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	-2,850,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS119429	20.03.2026			-376,515.01	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 21.09.20/20.03.26 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22)	5,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.09.20/20.03.26 USD 5%	-5,000,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS120906	20.03.2026			-26,356.05	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 21.09.20/20.03.26 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22)	350,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.09.20/20.03.26 USD 5%	-350,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS127162	20.03.2026			-29,945.83	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 22.03.21/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28)	5,300,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 22.03.21/20.03.26 USD 1%	-5,300,000.00	USD	1.0000		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS127313	20.03.2026			-5,254.65	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 22.03.21/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28)	930,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 22.03.21/20.03.26 USD 1%	-930,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS128121	20.06.2026			-357,681.85	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 21.06.21/20.06.26 USD MGIC Investment Corp. DL-Notes 2016(16/23)	4,300,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.06.21/20.06.26 USD 5%	-4,300,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS128905	20.03.2027			18,871.72	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 21.06.21/20.03.27 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24)	572,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 21.06.21/20.03.27 JPY 1%	-572,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS129687	20.03.2027			18,027.11	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.09.21/20.03.27 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24)	546,400,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.09.21/20.03.27 JPY 1%	-546,400,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS129997	20.03.2027			8,907.98	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.21/20.03.27 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24)	270,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.09.21/20.03.27 JPY 1%	-270,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS131825	20.12.2026			1,247.22	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.21/20.12.26 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24)	67,500,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.09.21/20.12.26 JPY 1%	-67,500,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS133217	20.12.2026			2,919.41	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.21/20.12.26 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24)	158,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.21/20.12.26 JPY 1%	-158,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS133977	20.03.2026			-75,303.00	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.12.21/20.03.26 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22)	1,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.12.21/20.03.26 USD 5%	-1,000,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS135092	20.06.2027			-20,571.77	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 21.03.22/20.06.27 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2018(18/28)	3,200,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.03.22/20.06.27 USD 1%	-3,200,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS135208	20.09.2025			-13,238.84	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 21.03.22/20.09.25 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26)	1,470,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.03.22/20.09.25 USD 1%	-1,470,000.00	USD	1.0000		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS136159	20.03.2026			-21,753.10	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 21.03.22/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28)	3,850,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.03.22/20.03.26 USD 1%	-3,850,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS139737	20.03.2026			-19,775.55	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 21.03.22/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28)	3,500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.03.22/20.03.26 USD 1%	-3,500,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS140336	20.03.2025			-13,146.86	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 21.06.22/20.03.25 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26)	2,220,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.06.22/20.03.25 USD 1%	-2,220,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS143163	20.06.2027			-178,440.43	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.27 USD MGIC Investment Corp. DL-Notes 2020(20/28)	1,520,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.27 USD 5%	-1,520,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS143172	20.06.2027			-189,005.99	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.27 USD MGIC Investment Corp. DL-Notes 2020(20/28)	1,610,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.27 USD 5%	-1,610,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS143420	20.06.2027			-113,514.84	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.27 USD Unisys Corp. DL-Notes 2020(20/27) 144A	2,950,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.27 USD 5%	-2,950,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS143622	20.06.2027			-38,479.61	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.27 USD Unisys Corp. DL-Notes 2020(20/27) 144A	1,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.27 USD 5%	-1,000,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS146114	20.09.2025			-19,547.71	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22) Reg.S	1,100,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.09.25 EUR 5%	-1,100,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS146115	20.09.2025			-19,547.71	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22) Reg.S	1,100,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.09.25 EUR 5%	-1,100,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS146751	20.12.2025			-2,428.93	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	300,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	-300,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS146752	20.12.2027			-9,888.15	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	1,200,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	-1,200,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146753	20.12.2027			-9,888.15	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	1,200,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	-1,200,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146754	20.12.2029			1,046.74	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	300,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	-300,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146755	20.12.2032			87,619.49	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	3,600,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	-3,600,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146756	20.12.2032			82,751.74	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	3,400,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	-3,400,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146757	20.12.2032			41,375.87	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	1,700,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	-1,700,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146759	20.09.2025			-5,943.97	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.09.25 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26)	660,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.09.25 USD 1%	-660,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS146799	20.12.2025			-6,072.32	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	750,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	-750,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146800	20.12.2027			-6,180.09	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	750,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	-750,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146801	20.12.2029			2,616.85	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	750,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	-750,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS146902	20.12.2032			103,439.67	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	4,250,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	-4,250,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146903	20.12.2025			-5,126.87	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S	500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	-500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146904	20.12.2027			-8,608.65	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S	500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	-500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146905	20.12.2028			-59,595.00	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.28 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S	3,600,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.28 EUR 1%	-3,600,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS147105	20.12.2029			-14,066.19	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	1,080,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	-1,080,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS147106	20.06.2032			-16,955.77	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR	1,825,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	-1,825,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS147107	20.06.2032			-13,564.62	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR	1,460,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	-1,460,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS147108	20.06.2032			-13,564.62	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR	1,460,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	-1,460,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS147271	20.12.2029			-31,258.19	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	2,400,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	-2,400,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS147292	20.12.2027			-101,793.71	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SENIOR	5,440,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	-5,440,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS148200	20.12.2029			8,583.80	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	260,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 JPY 1%	-260,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS148225	20.12.2029			8,055.56	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	244,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 JPY 1%	-244,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS148445	20.06.2028			-17,453.78	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.28 EUR Societe Generale SRO LAC	2,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.28 EUR 1%	-2,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148523	20.12.2025			-6,072.32	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	750,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 EUR 1%	-750,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148524	20.12.2027			-6,180.09	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	750,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 EUR 1%	-750,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148525	20.12.2029			2,616.85	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	750,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 EUR 1%	-750,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148526	20.12.2032			103,439.67	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	4,250,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.32 EUR 1%	-4,250,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148527	20.12.2027			-6,228.03	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	110,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 JPY 1%	-110,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS148629	20.06.2026			-36,101.25	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.26 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBL0	2,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.26 EUR 1%	-2,500,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS148690	20.12.2027			1,455.78	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2018(18/28)	2,400,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 USD 1%	-2,400,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS148724	20.12.2027			-3,906.67	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	69,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 JPY 1%	-69,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS148725	20.12.2029			10,036.44	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	304,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 JPY 1%	-304,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS148726	20.12.2025			-2,871.05	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S	280,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 EUR 1%	-280,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148727	20.12.2027			-33,401.58	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S	1,940,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 EUR 1%	-1,940,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148742	20.12.2025			-2,418.39	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	39,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 JPY 1%	-39,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS148743	20.12.2027			-1,528.70	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	27,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 JPY 1%	-27,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS148744	20.12.2029			9,673.28	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	293,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 JPY 1%	-293,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS148808	20.12.2025			-2,418.39	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	39,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 JPY 1%	-39,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS148809	20.12.2027			-1,528.70	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	27,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 JPY 1%	-27,000,000.00	JPY	1.0000		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS148810	20.12.2029			9,673.28	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	293,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 JPY 1%	-293,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS148820	20.12.2025			-4,216.68	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	68,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 JPY 1%	-68,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS148821	20.12.2029			9,673.28	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	293,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 JPY 1%	-293,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS149153	20.12.2029			4,787.12	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	145,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 JPY 1%	-145,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS149165	20.09.2030			9,913.03	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.09.30 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	153,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.09.30 JPY 1%	-153,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS149213	20.12.2025			-4,650.75	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	75,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 JPY 1%	-75,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS150376	20.09.2027			-459,001.66	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.12.22/20.09.27 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	3,600,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.09.27 USD 5%	-3,600,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS152255	20.06.2028			-30,544.12	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR Societe Generale SRO LAC	3,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 1%	-3,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS152257	20.06.2032			-13,007.17	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBL0	1,400,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.32 EUR 1%	-1,400,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS152307	20.06.2032			-21,740.55	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBL0	2,340,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.32 EUR 1%	-2,340,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS152548	20.06.2028			-645,856.10	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31)	4,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 USD 5%	-4,000,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS153012	20.06.2028			-33,479.82	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBL0	2,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 1%	-2,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS153118	20.06.2028			-5,130.91	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	125,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 JPY 1%	-125,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS153119	20.06.2030			27,114.02	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.30 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	500,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.30 JPY 1%	-500,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS153324	20.03.2026			-21,753.10	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28)	3,850,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.26 USD 1%	-3,850,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS153427	20.06.2028			-156,486.47	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 USD Louisiana Pacific Corp. DL-Notes 2021(21/29) 144A	1,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 USD 5%	-1,000,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS153428	20.06.2028			-312,972.95	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 USD Louisiana Pacific Corp. DL-Notes 2021(21/29) 144A	2,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 USD 5%	-2,000,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS153489	20.06.2033			761.78	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.33 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2020(25)	2,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.33 EUR 1%	-2,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS153490	20.03.2027			-19,683.60	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.27 EUR Societe Generale SRO LAC	2,125,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.27 EUR 1%	-2,125,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS153548	20.06.2033			761.78	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.33 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2020(25)	2,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.33 EUR 1%	-2,500,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS153565 CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.25 EUR Societe Generale SRO LAC CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 3,000,000.00 -3,000,000.00	EUR EUR	1.0000	-24,831.77	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS153656 CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.25 EUR Societe Generale SRO LAC CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 5,000,000.00 -5,000,000.00	EUR EUR	1.0000	-41,386.28	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS154046 CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.25 EUR Societe Generale SRO LAC CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 2,550,000.00 -2,550,000.00	EUR EUR	1.0000	-21,107.00	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS154054 CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.28 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.28 EUR 1%	20.06.2028 1,300,000.00 -1,300,000.00	EUR EUR	1.0000	-7,140.81	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS154055 CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(25) CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.32 EUR 1%	20.12.2032 5,850,000.00 -5,850,000.00	EUR EUR	1.0000	142,381.67	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS154112 CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.28 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 300,000,000.00 -300,000,000.00	JPY JPY	1.0000	-12,314.17	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS154197 CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.28 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2018(18/28) CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.28 USD 1%	20.06.2028 5,000,000.00 -5,000,000.00	USD USD	1.0000	36,778.65	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS154198 CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.28 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBLO CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.28 EUR 1%	20.06.2028 7,000,000.00 -7,000,000.00	EUR EUR	1.0000	-117,179.36	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS154204 CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 JPY Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2017(27) No. 9 CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 JPY 1%	20.12.2028 180,000,000.00 -180,000,000.00	JPY JPY	1.0000	97,325.74	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS154228 CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 JPY Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2017(27) No. 9 CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 JPY 1%	20.12.2028 630,000,000.00 -630,000,000.00	JPY JPY	1.0000	340,640.08	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS154229	20.06.2028			-1,027,662.13	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.28 USD Targa Resources Part.L.P./Fin. DL-Notes 2020(20/30)	6,600,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.28 USD 5%	-6,600,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS154288	20.12.2028			194,651.47	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 JPY Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2017(27) No. 9	360,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 JPY 1%	-360,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS154303	20.12.2028			102,732.72	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 JPY Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2017(27) No. 9	190,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 JPY 1%	-190,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS154414	20.12.2031			153,379.76	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.31 JPY Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2017(27) No. 9	170,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.31 JPY 1%	-170,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS154430	20.12.2031			153,379.76	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.31 JPY Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2017(27) No. 9	170,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.31 JPY 1%	-170,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS154514	20.12.2028			162,209.56	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 JPY Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2017(27) No. 9	300,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 JPY 1%	-300,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS154836	20.06.2028			41,192.09	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.28 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2018(18/28)	5,600,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.28 USD 1%	-5,600,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS154851	20.06.2028			-40,175.78	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.28 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBLO	2,400,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.28 EUR 1%	-2,400,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS155225	20.06.2033			914.14	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.33 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	3,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.33 EUR 1%	-3,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS155852	20.06.2027			-23,323.87	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.27 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26)	2,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.27 USD 1%	-2,000,000.00	USD	1.0000		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS155859	20.09.2025			-68,417.00	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22) Reg.S	3,850,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.09.25 EUR 5%	-3,850,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS155861	20.12.2027			-236,749.64	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.27 EUR TK Elevator Holdco GmbH Anleihe v.20(20/28) Reg.S	3,300,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.27 EUR 5%	-3,300,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS156275	20.12.2028			-40,065.81	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	2,460,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 EUR 1%	-2,460,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS156290	20.06.2027			-238,938.46	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.27 USD Pactiv LLC DL-Notes 1999(25)	1,900,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.27 USD 5%	-1,900,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS156347	20.06.2026			-85,913.03	HSBC Continental Europe S.A. - Paris
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.26 EUR Dufry One B.V. EO-Notes 2017(17/24)	1,100,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.26 EUR 5%	-1,100,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS156418	20.03.2025			-23,688.03	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.03.25 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26)	4,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.03.25 USD 1%	-4,000,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS156930	20.06.2026			-40,072.38	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.23/20.06.26 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBL0	2,775,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.06.26 EUR 1%	-2,775,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS157234	20.06.2026			-39,350.36	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.09.23/20.06.26 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBL0	2,725,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.06.26 EUR 1%	-2,725,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS157285	20.03.2025			-19,542.62	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.23/20.03.25 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26)	3,300,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.03.25 USD 1%	-3,300,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS157355	20.06.2026			-99,581.02	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.23/20.06.26 EUR Dufry One B.V. EO-Notes 2017(17/24)	1,275,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.06.26 EUR 5%	-1,275,000.00	EUR	5.0000		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS157357	20.06.2026			-30,325.05	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.23/20.06.26 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBL0	2,100,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.06.26 EUR 1%	-2,100,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS157926	20.12.2028			-1,408.34	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 EUR 1%	-500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS157927	20.12.2032			41,375.87	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.32 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	1,700,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.32 EUR 1%	-1,700,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS158044	20.12.2028			-1,408.34	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.23/20.12.28 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.12.28 EUR 1%	-500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS158045	20.12.2032			41,375.87	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.23/20.12.32 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	1,700,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.12.32 EUR 1%	-1,700,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS158148	20.12.2027			-807,729.15	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.23/20.12.27 USD Boyd Gaming Corp. DL-Notes 2015(15/23)	6,750,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.12.27 USD 5%	-6,750,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS158149	20.09.2027			-114,750.42	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.23/20.09.27 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	900,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.09.27 USD 5%	-900,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS158150	20.09.2027			-172,125.62	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.09.23/20.09.27 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	1,350,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.09.27 USD 5%	-1,350,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS158151	20.12.2028			-3,520.86	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.23/20.12.28 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	1,250,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.12.28 EUR 1%	-1,250,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS158152	20.12.2032			103,439.67	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.23/20.12.32 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	4,250,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.12.32 EUR 1%	-4,250,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS158624	20.09.2027			-520,258.97	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.09.27 USD Amkor Technology Inc. DL-Notes 2019(19/27) 144A	4,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.09.27 USD 5%	-4,000,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS158625	20.12.2027			-299,158.94	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.27 USD Boyd Gaming Corp. DL-Notes 2015(15/23)	2,500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.27 USD 5%	-2,500,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS158679	20.06.2033			548.48	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.33 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	1,800,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.33 EUR 1%	-1,800,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS158783	20.06.2033			959.84	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.33 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	3,150,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.33 EUR 1%	-3,150,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS158900	20.03.2027			-41,273.85	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.03.27 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S	2,625,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.03.27 EUR 1%	-2,625,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS159872	20.12.2025			-62,079.42	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.25 EUR Societe Generale SRO LAC	7,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.25 EUR 1%	-7,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS160158	20.12.2029			-13,024.25	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.29 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR	1,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.29 EUR 1%	-1,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS160159	20.03.2027			-66,824.32	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.06.23/20.03.27 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S	4,250,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.03.27 EUR 1%	-4,250,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS160160	20.03.2029			-191,640.82	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.06.23/20.03.29 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S	12,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.03.29 EUR 1%	-12,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS160161	20.06.2026			-61,372.12	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR	4,250,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.26 EUR 1%	-4,250,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS160180	20.12.2028				
CDS Reference Asset 20.09.23/20.12.28 USD Louisiana Pacific Corp. DL-Notes 2021(21/29) 144A	1,800,000.00	USD		-308,385.41	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.12.28 USD 5%	-1,800,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS160467	20.12.2025				
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.25 EUR Societe Generale SRO LAC	5,100,000.00	EUR		-42,214.00	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.25 EUR 1%	-5,100,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS160823	20.06.2026				
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.26 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBL0	4,250,000.00	EUR		-61,372.12	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.26 EUR 1%	-4,250,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS160830	20.12.2028				
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	1,000,000.00	EUR		-13,437.34	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 EUR 1%	-1,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS160831	20.06.2026				
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.26 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBL0	4,250,000.00	EUR		-61,372.12	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.26 EUR 1%	-4,250,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS160845	20.12.2028				
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(25)	2,000,000.00	EUR		-5,633.37	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 EUR 1%	-2,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS162462	20.03.2029				
CDS Reference Asset 20.12.23/20.03.29 EUR COMMERZBANK Aktiengesellschaft SRO SUB	4,300,000.00	EUR		122,696.84	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.03.29 EUR 1%	-4,300,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS162464	20.03.2029				
CDS Reference Asset 20.12.23/20.03.29 EUR COMMERZBANK Aktiengesellschaft SRO SUB	2,100,000.00	EUR		59,921.71	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.03.29 EUR 1%	-2,100,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS162525	20.09.2027				
CDS Reference Asset 20.12.23/20.09.27 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	2,700,000.00	USD		-344,251.25	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.09.27 USD 5%	-2,700,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS162526	20.09.2027				
CDS Reference Asset 20.12.23/20.09.27 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	2,700,000.00	USD		-344,251.25	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.09.27 USD 5%	-2,700,000.00	USD	5.0000		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS162754	20.06.2029			-96,532.90	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.12.23/20.06.29 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SENIOR	5,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.06.29 EUR 1%	-5,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS162755	20.06.2029			-48,266.45	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.23/20.06.29 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SENIOR	2,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.06.29 EUR 1%	-2,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS162788	20.12.2031			243,603.15	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.23/20.12.31 JPY Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2017(27) No. 9	270,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.12.31 JPY 1%	-270,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS162789	20.12.2028			-154,192.71	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.23/20.12.28 USD Louisiana Pacific Corp. DL-Notes 2021(21/29) 144A	900,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.12.28 USD 5%	-900,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS162832	20.09.2027			-172,125.62	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.23/20.09.27 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	1,350,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.09.27 USD 5%	-1,350,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS162833	20.12.2028			-231,289.06	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.12.23/20.12.28 USD Louisiana Pacific Corp. DL-Notes 2021(21/29) 144A	1,350,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.12.28 USD 5%	-1,350,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS162834	20.09.2027			-172,125.62	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.12.23/20.09.27 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	1,350,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.09.27 USD 5%	-1,350,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS163910	20.06.2027			174,989.18	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.12.23/20.06.27 USD Transocean Inc. DL-Notes 2020(20/27) 144A	6,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.06.27 USD 1%	-6,000,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS163912	20.12.2025			1,097.40	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.12.23/20.12.25 USD Transocean Inc. DL-Notes 2020(20/27) 144A	600,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.12.25 USD 1%	-600,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS164408	20.06.2033			1,218.85	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.23/20.06.33 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	4,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.06.33 EUR 1%	-4,000,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS164409	20.12.2028			-13,437.34	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.23/20.12.28 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	1,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.12.28 EUR 1%	-1,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS164410	20.12.2028			-13,437.34	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.23/20.12.28 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	1,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.12.28 EUR 1%	-1,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS164411	20.12.2033			9,521.92	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.23/20.12.33 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	4,250,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.12.33 EUR 1%	-4,250,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS164760	20.06.2030			-614,368.31	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.12.23/20.06.30 USD DaVita Inc. DL-Notes 2020(20/30) 144A	3,500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.06.30 USD 5%	-3,500,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS164852	20.06.2029			-342,749.40	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.23/20.06.29 EUR Sodexo S.A. EO-Notes 2014(14/26)	10,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.06.29 EUR 1%	-10,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS164921	20.06.2026			-53,273.14	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.26 EUR UBS AG SRO SENIOR	3,640,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.26 EUR 1%	-3,640,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS164995	20.12.2025			-47,180.36	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.12.25 EUR Societe Generale SRO LAC	5,700,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.12.25 EUR 1%	-5,700,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS165212	20.06.2034			510,521.48	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.34 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SUB	5,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.34 EUR 1%	-5,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS165213	20.06.2034			-168,819.83	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.34 EUR 1%	5,000,000.00	EUR	1.0000		
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.34 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(25)	-5,000,000.00	EUR			
SWAPCDS165214	20.06.2034			-67,527.93	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.34 EUR 1%	2,000,000.00	EUR	1.0000		
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.34 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(25)	-2,000,000.00	EUR			

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS165216	20.06.2034			204,208.59	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.34 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SUB	2,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.34 EUR 1%	-2,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS165219	20.12.2025			-99,950.25	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.12.25 USD Pactiv LLC DL-Notes 1999(25)	1,500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.12.25 USD 5%	-1,500,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS165221	20.12.2025			-99,950.25	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.12.25 USD Pactiv LLC DL-Notes 1999(25)	1,500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.12.25 USD 5%	-1,500,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS165592	20.06.2027			-38,485.01	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.27 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26)	3,300,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.27 USD 1%	-3,300,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS165647	20.03.2026			-194,123.89	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.03.26 EUR United Group B.V. EO-Bonds 2020(20/28) Reg.S	3,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.03.26 EUR 5%	-3,000,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS165811	20.03.2026			-226,477.87	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.03.24/20.03.26 EUR United Group B.V. EO-Bonds 2020(20/28) Reg.S	3,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.03.26 EUR 5%	-3,500,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS166353	20.09.2027			-57,010.19	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.03.24/20.09.27 USD FirstEnergy Corp. DL-Notes 2001(01/31) Ser.C	2,925,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.09.27 USD 1%	-2,925,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS166391	20.03.2029			57,068.30	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.03.29 EUR Commerzbank AG Ref ID: XSSUBREFOBL0	2,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.03.29 EUR 1%	-2,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS166393	20.03.2029			2,853.41	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.03.29 EUR Commerzbank AG Ref ID: XSSUBREFOBL0	100,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.03.29 EUR 1%	-100,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS166394	20.09.2028			-408,180.81	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.09.28 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	2,600,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.09.28 USD 5%	-2,600,000.00	USD	5.0000		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Kupon	Unrealisiertes Ergebnis	Gegenpartei
	Nominale 1	Whg 2	in %	in EUR	
	Nominale 2				
Credit Default Swaps					
SWAPCDS167102	20.09.2027			-11,344.29	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.09.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	176,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.09.27 JPY 1%	-176,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS167103	20.09.2027			-22,559.67	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.09.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	350,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.09.27 JPY 1%	-350,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS167456	20.12.2027			-38,346.54	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.12.27 USD Unisys Corp. DL-Conv. Nts 2016(21)	1,800,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.12.27 USD 5%	-1,800,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS167503	20.06.2027			16,769.80	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.27 USD Transocean Inc. DL-Notes 2020(20/27) 144A	575,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.27 USD 1%	-575,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS167577	20.06.2029			-303,458.25	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.29 USD Cloud Software Group Inc. DL-Notes 2023(23/29) 144A	5,500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.29 USD 5%	-5,500,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS167580	20.12.2025			-21,107.00	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.12.25 EUR Societe Generale SRO LAC	2,550,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.12.25 EUR 1%	-2,550,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS168267	20.06.2029			-82,761.34	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.24/20.06.29 USD Cloud Software Group Inc. DL-Notes 2023(23/29) 144A	1,500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.24/20.06.29 USD 5%	-1,500,000.00	USD	5.0000		
Credit Default Swaps gesamt				-10,627,925.63	
Swaps gesamt				2,849,424.33	
Derivate gesamt				-1,884,451.35	

XAIA Credit Basis II

XAIA Credit Basis II (I) Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres	Teilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres
2022	Stück 373,643.563	EUR 363,294,663.19	EUR 972.30
2023	Stück 270,430.587	EUR 264,809,881.60	EUR 979.22
30.06.2024	Stück 273,691.127	EUR 276,493,194.54	EUR 1,010.24

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	270,430.587
Ausgegebene Anteile	17,189.482
Zurückgenommene Anteile	-13,928.942
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	273,691.127

XAIA Credit Basis II

XAIA Credit Basis II (P)

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres	Teilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres
2022	Stück 51,656.687	EUR 4,906,127.26	EUR 94.98
2023	Stück 44,802.639	EUR 4,277,803.68	EUR 95.48
30.06.2024	Stück 57,758.517	EUR 5,670,661.01	EUR 98.18

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes
Ausgegebene Anteile
Zurückgenommene Anteile

Stücke

44,802.639
15,026.662
-2,070.784

Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes

57,758.517

XAIA Credit Basis II

XAIA Credit Basis II (IT)

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres	Teilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres
2022	Stück 214,011.409	EUR 237,154,958.63	EUR 1,108.14
2023	Stück 180,190.947	EUR 209,374,630.78	EUR 1,161.96
30.06.2024	Stück 173,525.947	EUR 208,023,171.87	EUR 1,198.80

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes
Ausgegebene Anteile
Zurückgenommene Anteile

Stücke

180,190.947
7,087.000
-13,752.000

Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes

173,525.947

XAIA Credit Basis II

XAIA Credit Basis II (R)

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Teilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2022	Stück	16,742.000	EUR	1,685,225.30	EUR	100.66
2023	Stück	15,042.000	EUR	1,526,399.82	EUR	101.48
30.06.2024	Stück	159,275.000	EUR	16,658,148.91	EUR	104.59

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	15,042.000
Ausgegebene Anteile	145,107.000
Zurückgenommene Anteile	-874.000
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	159,275.000

XAIA Credit Debt Capital

Vermögensübersicht zum 30.06.2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Teilfondsvermögen *)
I. Vermögensgegenstände	268,253,953.39	101.27
1. Anleihen	207,845,483.54	78.47
2. Derivate	-4,354,291.38	-1.64
3. Bankguthaben	60,225,486.13	22.74
4. Sonstige Vermögensgegenstände	4,537,275.10	1.71
II. Verbindlichkeiten	-3,376,017.20	-1.27
III. Teilfondsvermögen	264,877,936.19	100.00

*) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

XAIA Credit Debt Capital

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2024	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens *)
Bestandspositionen				EUR		207,845,483.54	78.47
Börsengehandelte Wertpapiere				EUR		70,465,838.18	26.60
Verzinsliche Wertpapiere				EUR		70,465,838.18	26.60
0,7500 % Dufry One B.V. SF-Conv. Bonds 2021(26)	CH1105195684	%	8,000	CHF	96.239	7,997,464.44	3.02
0,2500 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 21(26/27)	FR0014002X43	%	5,000	EUR	93.948	4,697,407.11	1.77
0,0500 % Deutsche Post AG Wandelschuldv.v.17(25)	DE000A2G87D4	%	5,000	EUR	96.319	4,815,959.91	1.82
6,6250 % Julius Baer Gruppe AG EO-FLR Cap.Bonds 2023(30/Und.)	XS2586873379	%	3,905	EUR	96.984	3,787,207.08	1.43
3,0000 % HSBC Holdings PLC LS-FLR Notes 2019(29/30)	XS2003500142	%	5,000	GBP	89.977	5,307,780.27	2.00
6,9500 % Bath & Body Works Inc. DL-Debts 2003(03/33)	US532716AK37	%	2,500	USD	96.965	2,262,157.84	0.85
7,6000 % Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2007(07/37)	US532716AN75	%	10,000	USD	95.895	8,948,740.70	3.38
4,0410 % HSBC Holdings PLC DL-FLR Notes 2017(27/28)	US404280BK42	%	5,000	USD	96.480	4,501,686.16	1.70
4,7550 % HSBC Holdings PLC DL-FLR Notes 2022(22/28)	US404280DF39	%	10,000	USD	98.289	9,172,171.64	3.46
11,2500 % Rakuten Group Inc. DL-Bonds 2024(24/27) Reg.S	USJ64264AG96	%	3,000	USD	107.288	3,003,575.63	1.13
7,4500 % Safeway Inc. DL-Debts. 1997(97/27)	US786514AS84	%	750	USD	103.282	722,859.63	0.27
9,3750 % Société Générale S.A. DL-FLR Notes 2022(Und.) Reg.S	USF8500RAC63	%	5,000	USD	101.335	4,728,208.09	1.79
7,7670 % Standard Chartered PLC DL-FLR Notes 2022(27/28) 144A	US853254CN89	%	5,000	USD	106.435	4,966,174.63	1.87
2,6080 % Standard Chartered PLC DL-FLR Notes 2022(27/28) 144A	US853254CG39	%	3,000	USD	92.798	2,597,915.98	0.98
7,0180 % Standard Chartered PLC DL-Notes 2023(29/30) 144A	US853254CX61	%	3,000	USD	105.607	2,956,529.07	1.12
An regulierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				EUR		113,901,013.19	43.00
Verzinsliche Wertpapiere				EUR		113,901,013.19	43.00
2,1250 % Cellnex Telecom S.A. EO-Conv.Med.-Term Bds 2023(30)	XS2597741102	%	14,200	EUR	100.143	14,220,360.73	5.37
1,9000 % WD Invest S.à.r.l. EO-Umtauschanl. 2019(24)	DE000A2R76L7	%	1,400	EUR	14.927	208,978.68	0.08
8,2480 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-FLR Pref.MTN 22(32/33) 144A	US46115HBV87	%	13,000	USD	110.741	13,434,461.15	5.07
8,2480 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-FLR Pref.MTN 22(32/33)Reg.S	XS2559133363	%	8,500	USD	110.735	8,783,562.53	3.32
6,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-Notes 2023(33) 144A X	US46115HBZ91	%	7,750	USD	103.681	7,498,395.60	2.83
4,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-Receipts 2019(29) Cl.X 144A	US46115HBL06	%	5,000	USD	92.249	4,304,259.58	1.62
5,0000 % Iron Mountain Inc. DL-Notes 2020(20/28) 144A	US46284VAG68	%	4,000	USD	95.589	3,568,077.58	1.35
4,3450 % Nissan Motor Co. Ltd. DL-Notes 2020(20/27) 144A	US654744AC50	%	7,500	USD	95.562	6,688,265.99	2.53
4,8100 % Nissan Motor Co. Ltd. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USJ57160DZ32	%	8,200	USD	93.082	7,122,718.83	2.69
6,2500 % Post Holdings Inc. DL-Notes 2024(24/32) 144A	US737446AU86	%	2,000	USD	100.195	1,870,014.18	0.71
1,4880 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 20(25/26) 144A	US83368RAZ55	%	10,000	USD	93.615	8,736,007.25	3.30
1,4880 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 20(25/26)Reg.S	US83368TAZ12	%	15,000	USD	93.615	13,104,010.87	4.95
6,4460 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 23(28/29) 144A	US83368RBR21	%	10,000	USD	101.552	9,476,676.94	3.58
6,1250 % Tenet Healthcare Corp. DL-Notes 2023(23/30)	US88033GDQ01	%	10,000	USD	99.792	9,312,474.69	3.52
1,9820 % UniCredit S.p.A. DL-FLR Pref. MTN 2021(26/27)	XS2348710562	%	6,405	USD	93.236	5,572,748.59	2.10

XAIA Credit Debt Capital

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2024	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens *)
Nichtnotierte Wertpapiere				EUR		23,478,632.17	8.86
Verzinsliche Wertpapiere				EUR		23,478,632.17	8.86
7,5000 % Alb.Cos LLC/Safe.Inc./N.A.I./A. DL-Notes 2019(19/26) 144A	US013092AA91	%	1,200	USD	101.211	1,133,386.70	0.43
1,9820 % UniCredit S.p.A. DL-FLR Pref. MTN 2021(26/27)	US904678AW97	%	14,500	USD	93.236	12,615,902.35	4.76
3,1270 % UniCredit S.p.A. DL-FLR Pref. MTN 2021(31/32)	US904678AY53	%	12,250	USD	85.110	9,729,343.12	3.67
Summe Wertpapiervermögen				EUR		207,845,483.54	78.47
Derivate				EUR		-4,354,291.38	-1.64
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds				EUR		60,225,486.13	22.74
Bankguthaben				EUR		60,225,486.13	22.74
Guthaben bei Skandinaviska Enskilda Banken AB Stockholm Tagesgeld							
			5,592.53	CHF		5,809.21	0.00
			2,266.89	GBP		2,674.48	0.00
Guthaben bei Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							
			4,120.82	CHF		4,280.49	0.00
			926,041.75	USD		864,167.37	0.33
			0.99	ZAR		0.05	0.00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen (Initial Margin)							
			143,000.00	USD		133,445.32	0.05
Guthaben in Fondswährung (Cash Collateral)							
			5,500,000.00	EUR		5,500,000.00	2.08
Guthaben in Fondswährung (Initial Margin)							
			302,500.00	EUR		302,500.00	0.11
Guthaben in Fondswährung (Variation Margin)							
			64,965.00	EUR		64,965.00	0.02
Guthaben bei Bayerische Landesbank München Tagesgeld							
			33,000,000.00	EUR		33,000,000.00	12.46

XAIA Credit Debt Capital

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2024	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens *)
Guthaben bei Landesbank Baden-Württemberg Stuttgart Guthaben in Fondswährung			5,000,000.00	EUR		5,000,000.00	1.89
Tagesgeld			2,000,000.00	EUR		2,000,000.00	0.76
			7,000,000.00	USD		6,532,288.17	2.47
Guthaben bei Sparkasse Saarbrücken Guthaben in Fondswährung			5,000,000.00	EUR		5,000,000.00	1.89
Tagesgeld			1,000,000.00	EUR		1,000,000.00	0.38
Guthaben bei SUMITOMO MITSUI TRUST BANK Ltd. GB Tagesgeld			298,380.35	EUR		298,380.35	0.11
			1,786,737.00	JPY		10,366.54	0.00
Guthaben bei DBS Group Holdings Ltd., Singapore Tagesgeld			542,882.36	USD		506,609.15	0.19
Sonstige Vermögensgegenstände				EUR		4,537,275.10	1.71
Zinsansprüche			2,368,737.03	EUR		2,368,737.03	0.89
Zinsansprüche Swaps			2,167,294.74	EUR		2,167,294.74	0.82
Sonstige Forderungen			1,243.33	EUR		1,243.33	0.00
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme				EUR		-156,099.35	-0.04
Kredite bei Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. EUR - Kredite			-138,219.65	EUR		-138,219.65	-0.05
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen (Variation Margin)			-15,300.00	USD		-14,277.72	0.01
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen			-3,053.04	GBP		-3,601.98	0.00

XAIA Credit Debt Capital

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2024	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens *)
Verbindlichkeiten				EUR		-3,219,917.85	-1.22
Zinsverbindlichkeiten Swaps			-2,707,886.93	EUR		-2,707,886.93	-1.02
Verwaltungsvergütung			-107,841.70	EUR		-107,841.70	-0.04
Performance Fee			-310,220.15	EUR		-310,220.15	-0.12
Verwahrstellenvergütung			-9,711.69	EUR		-9,711.69	0.00
Depotgebühren			-34,074.59	EUR		-34,074.59	-0.01
Prüfungs- und Veröffentlichungskosten			-33,625.01	EUR		-33,625.01	-0.01
Taxe d'abonnement			-8,691.11	EUR		-8,691.11	0.00
Sonstige Verbindlichkeiten			-7,866.67	EUR		-7,866.67	0.00
Teilfondsvermögen				EUR		264,877,936.19	100.00
XAIA Credit Debt Capital (I)							
Anteilwert				EUR		1,053.62	
Ausgabepreis				EUR		1,053.62	
Rücknahmepreis				EUR		1,053.62	
Anteile im Umlauf				STK		56,992.178	
XAIA Credit Debt Capital (P)							
Anteilwert				EUR		102.46	
Ausgabepreis				EUR		105.53	
Rücknahmepreis				EUR		102.46	
Anteile im Umlauf				STK		61,148.311	
XAIA Credit Debt Capital (V)							
Anteilwert				EUR		103.81	
Ausgabepreis				EUR		109.00	
Rücknahmepreis				EUR		103.81	
Anteile im Umlauf				STK		113,879.095	

XAIA Credit Debt Capital

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2024	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilfonds- vermögens *)
XAIA Credit Debt Capital (IT)							
Anteilwert				EUR		1,250.23	
Ausgabepreis				EUR		1,250.23	
Rücknahmepreis				EUR		1,250.23	
Anteile im Umlauf				STK		136,220.561	
XAIA Credit Debt Capital (R)							
Anteilwert				EUR		103.15	
Ausgabepreis				EUR		106.24	
Rücknahmepreis				EUR		103.15	
Anteile im Umlauf				STK		159,345.000	

*) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Devisentermingeschäfte zum 30.06.2024

	Währung	Betrag		Währung	Betrag	Fälligkeit	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Verkauf	CHF	-7,235,000.00	Kauf	EUR	7,472,818.72	05.07.2024	-46,466.33	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	GBP	-4,023,000.00	Kauf	EUR	4,725,483.25	05.07.2024	-19,533.00	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	JPY	-158,000,000.00	Kauf	EUR	933,979.25	05.07.2024	16,583.93	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	JPY	-14,020,000.00	Kauf	EUR	82,976.85	05.07.2024	1,572.53	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Verkauf	JPY	-7,200,000.00	Kauf	EUR	42,411.52	05.07.2024	606.16	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Verkauf	JPY	-1,700,000.00	Kauf	EUR	10,028.37	05.07.2024	157.66	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	JPY	-1,700,000.00	Kauf	EUR	10,029.55	05.07.2024	158.84	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Verkauf	USD	-180,300,000.00	Kauf	EUR	165,737,613.73	05.07.2024	-2,462,726.59	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
Verkauf	USD	-1,100,000.00	Kauf	EUR	1,021,349.93	05.07.2024	-4,830.74	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Verkauf	USD	-2,000,000.00	Kauf	EUR	1,859,537.60	05.07.2024	-6,245.43	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	USD	-120,000.00	Kauf	EUR	111,626.07	05.07.2024	-320.91	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	USD	-1,120,000.00	Kauf	EUR	1,040,778.15	05.07.2024	-4,060.35	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	USD	-1,970,000.00	Kauf	EUR	1,837,277.46	05.07.2024	-518.83	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	USD	-5,071,000.00	Kauf	EUR	4,745,474.23	05.07.2024	14,781.35	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
Summe Devisentermingeschäfte							-2,510,841.71	

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Finanzterminkontrakte zum 30.06.2024

Kontraktbezeichnung	Fälligkeit	Anzahl	Währung	Einstandspreis in Whg	Tagespreis in Whg	Unrealisiertes Ergebnis in EUR
FUTURE CAC 40 INDEX 19.07.24 MONEP	19.07.2024	55.00	EUR	7,610.7632	7,492.5000	-64,965.00
FUTURE E-MINI RUSS.2000 IND. 20.09.24 CME	20.09.2024	20.00	USD	2,049.7660	2,065.0000	14,277.72
Summe Finanzterminkontrakte						-50,687.28

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Optionen zum 30.06.2024

Kontraktbezeichnung	Fälligkeit	Anzahl	Währung	Einstandspreis in Whg	Tagespreis in Whg	Tageswert in EUR	Unrealisiertes Ergebnis in EUR
AMERICAN AIRL. PUT 17.01.25 BP 3,00 CBOE	17.01.2025	5,100.00	USD	0.5102	0.0222	10,575.48	-259,147.75
JUL. BAER GRP. NAM. PUT 20.12.24 BP 24,00 EUREX	20.12.2024	1,365.00	CHF	0.5040	0.0076	1,078.48	-70,303.49
STE GENERALE INH. PUT 20.06.25 BP 10,00 EUREX	20.06.2025	4,800.00	EUR	0.2538	0.2050	98,405.45	-23,440.55
TEVA PHARM. IND.ADR PUT 17.01.25 BP 3,00 CBOE	17.01.2025	4,950.00	USD	0.3324		15.45	-169,629.47
Summe Optionen						110,074.86	

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS107524	01.11.2024				
Floating Leg 01.11.19/01.11.24 EUR 3,835% (Floater)	5,000,000.00	EUR	3.8350 variabel	68,969.00	J.P. Morgan SE Frankfurt
Fixed Leg 01.11.19/01.11.24 EUR -0,307% (Zinssatz fest)	-5,000,000.00	EUR	-0.3070 fix		
SWAPIRS113648	07.04.2027				
Floating Leg 07.04.20/07.04.27 USD 5,56345% (Floater)	2,000,000.00	USD	5.5635 variabel	195,436.22	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 07.04.20/07.04.27 USD 0,555% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	USD	0.5550 fix		
SWAPIRS114494	12.05.2025				
Floating Leg 12.05.20/12.05.25 USD 5,58514% (Floater)	2,000,000.00	USD	5.5851 variabel	78,172.43	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 12.05.20/12.05.25 USD 0,4035% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	USD	0.4035 fix		
SWAPIRS115267	01.06.2028				
Floating Leg 01.06.20/01.06.28 USD 5,60769% (Floater)	6,000,000.00	USD	5.6077 variabel	763,666.34	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 01.06.20/01.06.28 USD 0,587% (Zinssatz fest)	-6,000,000.00	USD	0.5870 fix		
SWAPIRS119827	19.10.2027				
Floating Leg 19.10.20/19.10.27 USD 5,58817% (Floater)	7,000,000.00	USD	5.5882 variabel	791,250.10	Deutsche Bank AG London
Fixed Leg 19.10.20/19.10.27 USD 0,524% (Zinssatz fest)	-7,000,000.00	USD	0.5240 fix		
SWAPIRS122603	24.02.2031				
Floating Leg 24.02.21/24.02.31 USD 5,59246% (Floater)	900,000.00	USD	5.5925 variabel	133,990.74	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 24.02.21/24.02.31 USD 1,452% (Zinssatz fest)	-900,000.00	USD	1.4520 fix		
SWAPIRS127143	10.06.2025				
Floating Leg 10.06.21/10.06.25 USD 5,59605% (Floater)	1,700,000.00	USD	5.5961 variabel	68,332.87	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 10.06.21/10.06.25 USD 0,635% (Zinssatz fest)	-1,700,000.00	USD	0.6350 fix		
SWAPIRS133521	10.02.2026				
Floating Leg 10.02.22/10.02.26 EUR 3,814% (Floater)	1,000,000.00	EUR	3.8140 variabel	43,776.71	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 10.02.22/10.02.26 EUR 0,458% (Zinssatz fest)	-1,000,000.00	EUR	0.4580 fix		
SWAPIRS146709	16.11.2027				
Floating Leg 16.11.22/16.11.27 EUR 3,824% (Floater)	2,300,000.00	EUR	3.8240 variabel	16,957.57	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 16.11.22/16.11.27 EUR 2,704% (Zinssatz fest)	-2,300,000.00	EUR	2.7040 fix		
SWAPIRS146917	21.11.2032				
Floating Leg 21.11.22/21.11.32 USD 5,31946% (Floater)	3,000,000.00	USD	5.3192 variabel	92,361.82	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 21.11.22/21.11.32 USD 3,427% (Zinssatz fest)	-3,000,000.00	USD	3.4270 fix		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS147118	23.11.2028			30,939.72	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 23.11.22/23.11.28 USD (Floater)	2,250,000.00	USD	5.3192 variabel		
Fixed Leg 23.11.22/23.11.28 USD 3,703% (Zinssatz fest)	-2,250,000.00	USD	3.7030 fix		
SWAPIRS147260	30.11.2028			29,157.26	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 30.11.22/30.11.28 USD 5,31848% (Floater)	1,500,000.00	USD	5.3182 variabel		
Fixed Leg 30.11.22/30.11.28 USD 3,55% (Zinssatz fest)	-1,500,000.00	USD	3.5500 fix		
SWAPIRS147262	30.11.2032			45,926.80	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 30.11.22/30.11.32 USD 5,31848% (Floater)	1,350,000.00	USD	5.3182 variabel		
Fixed Leg 30.11.22/30.11.32 USD 3,379% (Zinssatz fest)	-1,350,000.00	USD	3.3790 fix		
SWAPIRS147267	29.11.2031			57,653.11	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 29.11.22/29.11.31 USD 3,426% (Floater)	2,000,000.00	USD	5.3192 variabel		
Fixed Leg 29.11.22/29.11.31 USD 3,426% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	USD	3.4260 fix		
SWAPIRS147374	06.12.2028			70,209.04	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 06.12.22/06.12.28 USD 5,31816% (Floater)	2,550,000.00	USD	5.3178 variabel		
Fixed Leg 06.12.22/06.12.28 USD 3,334% (Zinssatz fest)	-2,550,000.00	USD	3.3340 fix		
SWAPIRS148563	13.01.2033			87,587.83	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 13.01.23/13.01.33 USD 5,31554% (Floater)	2,000,000.00	USD	5.3151 variabel		
Fixed Leg 13.01.23/13.01.33 USD 3,238% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	USD	3.2380 fix		
SWAPIRS148644	19.01.2032			32,699.90	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 19.01.23/19.01.32 USD 5,31565% (Floater)	800,000.00	USD	5.3152 variabel		
Fixed Leg 19.01.23/19.01.32 USD 3,2315% (Zinssatz fest)	-800,000.00	USD	3.2315 fix		
SWAPIRS148860	02.02.2028			133,499.92	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 02.02.23/02.02.28 USD 5,31558% (Floater)	5,700,000.00	USD	5.3151 variabel		
Fixed Leg 02.02.23/02.02.28 USD 3,419% (Zinssatz fest)	-5,700,000.00	USD	3.4190 fix		
SWAPIRS149069	07.02.2031			143,828.29	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 07.02.23/07.02.31 USD 5,31573% (Floater)	4,000,000.00	USD	5.3152 variabel		
Fixed Leg 07.02.23/07.02.31 USD 3,265% (Zinssatz fest)	-4,000,000.00	USD	3.2650 fix		
SWAPIRS149249	13.02.2030			74,262.69	Deutsche Bank AG Frankfurt
Floating Leg 13.02.23/13.02.30 USD 5,31606% (Floater)	2,800,000.00	USD	5.3155 variabel		
Fixed Leg 13.02.23/13.02.30 USD 3,407% (Zinssatz fest)	-2,800,000.00	USD	3.4070 fix		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS149366	15.02.2033				
Floating Leg 15.02.23/15.02.33 USD 5,31634% (Floater)	1,600,000.00	USD	5.3158 variabel	48,145.69	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 15.02.23/15.02.33 USD 3,445% (Zinssatz fest)	-1,600,000.00	USD	3.4450 fix		
SWAPIRS152538	24.04.2033				
Floating Leg 24.04.23/24.04.33 USD 5,32% (Floater)	1,300,000.00	USD	5.3189 variabel	56,838.04	Deutsche Bank AG London
Fixed Leg 24.04.23/24.04.33 USD 3,2515% (Zinssatz fest)	-1,300,000.00	USD	3.2515 fix		
SWAPIRS152546	26.04.2033				
Floating Leg 26.04.23/26.04.33 USD 5,32% (Floater)	2,200,000.00	USD	5.3190 variabel	95,300.72	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 26.04.23/26.04.33 USD 3,2575% (Zinssatz fest)	-2,200,000.00	USD	3.2575 fix		
SWAPIRS153009	18.05.2026				
Floating Leg 18.05.23/18.05.26 USD 5,32429% (Floater)	4,500,000.00	USD	5.3231 variabel	77,012.27	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 18.05.23/18.05.26 USD 3,57875% (Zinssatz fest)	-4,500,000.00	USD	3.5788 fix		
SWAPIRS153104	24.05.2033				
Floating Leg 24.05.23/24.05.33 USD 5,32629% (Floater)	500,000.00	USD	5.3250 variabel	16,137.88	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 24.05.23/24.05.33 USD 3,419% (Zinssatz fest)	-500,000.00	USD	3.4190 fix		
SWAPIRS153152	26.05.2029				
Floating Leg 26.05.23/26.05.29 USD 5,32647% (Floater)	4,000,000.00	USD	5.3252 variabel	90,813.28	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 26.05.23/26.05.29 USD 3,466% (Zinssatz fest)	-4,000,000.00	USD	3.4660 fix		
SWAPIRS153276	05.06.2033				
Floating Leg 05.06.23/05.06.33 USD 5,33% (Floater)	2,000,000.00	USD	5.3300 variabel	61,864.36	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 05.06.23/05.06.33 USD 3,439% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	USD	3.4390 fix		
SWAPIRS153277	05.06.2028				
Floating Leg 05.06.23/05.06.28 USD 5,32385% (Floater)	1,800,000.00	USD	5.3217 variabel	30,791.90	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 05.06.23/05.06.28 USD 3,608% (Zinssatz fest)	-1,800,000.00	USD	3.6080 fix		
SWAPIRS153325	06.06.2030				
Floating Leg 06.06.23/06.06.30 USD 5,32238% (Floater)	2,400,000.00	USD	5.3194 variabel	64,900.07	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 06.06.23/06.06.30 USD 3,402% (Zinssatz fest)	-2,400,000.00	USD	3.4020 fix		
SWAPIRS153335	07.06.2031				
Floating Leg 07.06.23/07.06.31 USD 5,32238% (Floater)	3,300,000.00	USD	5.3194 variabel	83,439.07	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 07.06.23/07.06.31 USD 3,46875% (Zinssatz fest)	-3,300,000.00	USD	3.4688 fix		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS153375	13.06.2028			24,325.72	Deutsche Bank AG London
Floating Leg 13.06.23/13.06.28 USD 5,32714% (Floater)	1,600,000.00	USD	5.3236 variabel		
Fixed Leg 13.06.23/13.06.28 USD 3,663% (Zinssatz fest)	-1,600,000.00	USD	3.6630 fix		
SWAPIRS153376	13.06.2030			40,535.47	Deutsche Bank AG London
Floating Leg 13.06.23/13.06.30 USD 5,32333% (Floater)	2,000,000.00	USD	5.3200 variabel		
Fixed Leg 13.06.23/13.06.30 USD 3,5405% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	USD	3.5405 fix		
SWAPIRS153918	05.07.2032			-41,674.94	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 05.07.23/05.07.32 EUR 3,857% (Floater)	2,300,000.00	EUR	3.8570 variabel		
Fixed Leg 05.07.23/05.07.32 EUR 3,034% (Zinssatz fest)	-2,300,000.00	EUR	3.0340 fix		
SWAPIRS153947	10.07.2026			857.60	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 10.07.23/10.07.26 USD 5,30305% (Floater)	3,600,000.00	USD	5.3027 variabel		
Fixed Leg 10.07.23/10.07.26 USD 4,523% (Zinssatz fest)	-3,600,000.00	USD	4.5230 fix		
SWAPIRS153948	10.07.2026			868.68	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 10.07.23/10.07.26 USD 5,30305% (Floater)	2,500,000.00	USD	5.3027 variabel		
Fixed Leg 10.07.23/10.07.26 USD 4,5169% (Zinssatz fest)	-2,500,000.00	USD	4.5169 fix		
SWAPIRS154107	13.07.2025			-31,490.69	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 13.07.23/13.07.25 CHF (Floater)	3,000,000.00	CHF	variabel		
Fixed Leg 13.07.23/13.07.25 CHF 2% (Zinssatz fest)	-3,000,000.00	CHF	2.0000 fix		
SWAPIRS154317	28.07.2025			-19,460.55	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 28.07.23/28.07.25 CHF (Floater)	2,000,000.00	CHF	variabel		
Fixed Leg 28.07.23/28.07.25 CHF 1,89% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	CHF	1.8900 fix		
SWAPIRS154415	31.07.2026			-53,727.89	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 31.07.23/31.07.26 CHF (Floater)	2,600,000.00	CHF	variabel		
Fixed Leg 31.07.23/31.07.26 CHF 1,8725% (Zinssatz fest)	-2,600,000.00	CHF	1.8725 fix		
SWAPIRS156413	15.09.2025			-8,912.30	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 15.09.23/15.09.25 EUR 3,719% (Floater)	3,000,000.00	EUR	3.7190 variabel		
Fixed Leg 15.09.23/15.09.25 EUR 3,6745% (Zinssatz fest)	-3,000,000.00	EUR	3.6745 fix		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS156810	25.09.2026			-9,114.93	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 25.09.23/25.09.26 USD 5,31825% (Floater)	2,000,000.00	USD	5.3180 variabel		
Fixed Leg 25.09.23/25.09.26 USD 4,72% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	USD	4.7200 fix		
SWAPIRS157230	27.09.2026			-7,681.86	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 27.09.23/27.09.26 USD 5,31831% (Floater)	2,000,000.00	USD	5.3181 variabel		
Fixed Leg 27.09.23/27.09.26 USD 4,681% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	USD	4.6810 fix		
SWAPIRS157276	28.09.2030			-21,997.89	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 28.09.23/28.09.30 USD (Floater)	1,300,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 28.09.23/28.09.30 USD 4,2776% (Zinssatz fest)	-1,300,000.00	USD	4.2776 fix		
SWAPIRS158673	23.10.2033			-10,457.90	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 23.10.23/23.10.33 USD (Floater)	200,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 23.10.23/23.10.33 USD 4,6061% (Zinssatz fest)	-200,000.00	USD	4.6061 fix		
SWAPIRS158895	24.10.2032			-168,257.61	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 24.10.23/24.10.32 USD 5,3192% (Floater)	3,500,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 24.10.23/24.10.32 USD 4,626% (Zinssatz fest)	-3,500,000.00	USD	4.6260 fix		
SWAPIRS159868	09.11.2026			-10,506.79	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 09.11.23/09.11.26 USD 5,31936% (Floater)	10,000,000.00	USD	5.3191 variabel		
Fixed Leg 09.11.23/09.11.26 USD 4,5075% (Zinssatz fest)	-10,000,000.00	USD	4.5075 fix		
SWAPIRS160166	17.11.2026			37.56	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 17.11.23/17.11.26 USD 5,31934% (Floater)	7,500,000.00	USD	5.3191 variabel		
Fixed Leg 17.11.23/17.11.26 USD 4,4505% (Zinssatz fest)	-7,500,000.00	USD	4.4505 fix		
SWAPIRS160169	17.11.2029			-20,906.11	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 17.11.23/17.11.29 USD 5,31934% (Floater)	2,000,000.00	USD	5.3191 variabel		
Fixed Leg 17.11.23/17.11.29 USD 4,224% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	USD	4.2240 fix		
SWAPIRS160420	28.11.2029			-35,137.73	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 28.11.23/28.11.29 EUR 3,808% (Floater)	3,000,000.00	EUR	3.8080 variabel		
Fixed Leg 28.11.23/28.11.29 EUR 3,048% (Zinssatz fest)	-3,000,000.00	EUR	3.0480 fix		
SWAPIRS160421	28.11.2030			-16,443.38	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 28.11.23/28.11.30 EUR 3,808% (Floater)	1,100,000.00	EUR	3.8080 variabel		
Fixed Leg 28.11.23/28.11.30 EUR 3,048% (Zinssatz fest)	-1,100,000.00	EUR	3.0480 fix		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS160947	15.12.2031			20,638.47	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 15.12.23/15.12.31 USD (Floater)	3,300,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 15.12.23/15.12.31 USD 3,806% (Zinssatz fest)	-3,300,000.00	USD	3.8060 fix		
SWAPIRS162741	10.01.2029			80,323.25	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 10.01.24/10.01.29 GBP (Floater)	4,300,000.00	GBP	variabel		
Fixed Leg 10.01.24/10.01.29 GBP 3,663% (Zinssatz fest)	-4,300,000.00	GBP	3.6630 fix		
SWAPIRS162757	11.01.2033			39,842.02	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 11.01.24/11.01.33 USD 5,31541% (Floater)	2,250,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 11.01.24/11.01.33 USD 3,627% (Zinssatz fest)	-2,250,000.00	USD	3.6270 fix		
SWAPIRS163143	01.02.2026			91,232.63	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 01.02.24/01.02.26 USD (Floater)	11,000,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 01.02.24/01.02.26 USD 4,1715% (Zinssatz fest)	-11,000,000.00	USD	4.1715 fix		
SWAPIRS164726	12.03.2031			25,445.65	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 12.03.24/12.03.31 USD 5,31802% (Floater)	2,400,000.00	USD	5.3174 variabel		
Fixed Leg 12.03.24/12.03.31 USD 3,736% (Zinssatz fest)	-2,400,000.00	USD	3.7360 fix		
SWAPIRS164998	26.03.2030			48,964.96	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 26.03.24/26.03.30 EUR 3,682% (Floater)	5,500,000.00	EUR	3.6820 variabel		
Fixed Leg 26.03.24/26.03.30 EUR 2,623% (Zinssatz fest)	-5,500,000.00	EUR	2.6230 fix		
SWAPIRS165211	01.04.2027			16,262.12	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 01.04.24/01.04.27 USD (Floater)	6,000,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 01.04.24/01.04.27 USD 4,2315% (Zinssatz fest)	-6,000,000.00	USD	4.2315 fix		
SWAPIRS167107	10.05.2027			-24,471.62	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 10.05.24/10.05.27 USD (Floater)	5,000,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 10.05.24/10.05.27 USD 4,509% (Zinssatz fest)	-5,000,000.00	USD	4.5090 fix		
SWAPIRS167399	21.05.2034			-64,717.85	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 21.05.24/21.05.34 USD (Floater)	5,000,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 21.05.24/21.05.34 USD 4,0461% (Zinssatz fest)	-5,000,000.00	USD	4.0461 fix		
SWAPIRS167418	24.05.2031			-47,499.63	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 24.05.24/24.05.31 USD (Floater)	3,100,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 24.05.24/24.05.31 USD 4,1415% (Zinssatz fest)	-3,100,000.00	USD	4.1415 fix		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS167446	29.05.2034			-23,670.20	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 29.05.24/29.05.34 USD (Floater)	1,300,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 29.05.24/29.05.34 USD 4,1145% (Zinssatz fest)	-1,300,000.00	USD	4.1145 fix		
SWAPIRS167505	06.06.2033			-13,927.33	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 06.06.24/06.06.33 USD (Floater)	1,900,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 06.06.24/06.06.33 USD 3,9875% (Zinssatz fest)	-1,900,000.00	USD	3.9875 fix		
SWAPIRS167517	07.06.2030			-426.11	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 07.06.24/07.06.30 EUR 3,772% (Floater)	1,500,000.00	EUR	3.7720 variabel		
Fixed Leg 07.06.24/07.06.30 EUR 2,797% (Zinssatz fest)	-1,500,000.00	EUR	2.7970 fix		
SWAPIRS167567	13.06.2027			-40,194.78	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 13.06.24/13.06.27 USD (Floater)	8,000,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 13.06.24/13.06.27 USD 4,478% (Zinssatz fest)	-8,000,000.00	USD	4.4780 fix		
SWAPIRS167569	13.06.2026			-22,848.06	BNP Paribas S.A. Paris
Floating Leg 13.06.24/13.06.26 USD (Floater)	8,500,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 13.06.24/13.06.26 USD 4,7208% (Zinssatz fest)	-8,500,000.00	USD	4.7208 fix		
SWAPIRS167837	18.06.2027			4,391.50	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 18.06.24/18.06.27 USD (Floater)	4,800,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 18.06.24/18.06.27 USD 4,243% (Zinssatz fest)	-4,800,000.00	USD	4.2430 fix		
SWAPIRS167961	25.06.2030			2,986.93	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Floating Leg 25.06.24/25.06.30 USD (Floater)	2,000,000.00	USD	variabel		
Fixed Leg 25.06.24/25.06.30 USD 3,9215% (Zinssatz fest)	-2,000,000.00	USD	3.9215 fix		
Zinsswaps gesamt				3,287,108.05	

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Kupon	Unrealisiertes Ergebnis	Gegenpartei
	Nominale 1	Whg 2	in %	in EUR	
	Nominale 2				
Credit Default Swaps					
SWAPCDS114439	20.06.2025			-55,453.86	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31)	1,250,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	-1,250,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS144409	20.12.2024			26,937.34	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.24 USD 5%	1,500,000.00	USD	5.0000		
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.24 USD American Airlines Group Inc. DL-Notes 2020(20/25) 144A	-1,500,000.00	USD			
SWAPCDS146747	20.12.2025			-2,428.88	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	300,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	-300,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146748	20.12.2027			-2,471.89	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	300,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	-300,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146749	20.12.2029			1,046.58	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	300,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	-300,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146750	20.12.2032			41,368.07	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	1,700,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	-1,700,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146906	20.12.2025			-3,643.32	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	450,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	-450,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146907	20.12.2027			-3,707.84	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	450,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	-450,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146908	20.12.2029			1,569.87	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	450,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	-450,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146909	20.12.2032			62,052.10	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	2,550,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	-2,550,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Kupon	Unrealisiertes Ergebnis	Gegenpartei
	Nominale 1	Whg 2	in %	in EUR	
	Nominale 2				
Credit Default Swaps					
SWAPCDS146910	20.12.2025			-2,563.38	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S	250,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	-250,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146911	20.12.2027			-4,304.14	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S	250,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	-250,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS146912	20.12.2028			-29,795.36	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.28 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S	1,800,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.28 EUR 1%	-1,800,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS147109	20.06.2032			-6,781.22	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR	730,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	-730,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS147110	20.06.2032			-6,781.22	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR	730,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	-730,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS147221	20.12.2027			-59,397.15	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S	3,450,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	-3,450,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS147223	20.06.2032			-8,476.53	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR	912,500.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	-912,500.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS147224	20.06.2032			-6,781.22	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR	730,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	-730,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS147225	20.06.2032			-6,781.22	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR	730,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	-730,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Kupon	Unrealisiertes Ergebnis	Gegenpartei
	Nominale 1	Whg 2	in %	in EUR	
	Nominale 2				
Credit Default Swaps					
SWAPCDS147293	20.12.2027			-50,894.50	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SENIOR	2,720,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	-2,720,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148444	20.06.2028			-26,179.28	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.28 EUR Societe Generale SRO LAC	3,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.28 EUR 1%	-3,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148519	20.12.2025			-3,036.10	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	375,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 EUR 1%	-375,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148520	20.12.2027			-3,089.86	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	375,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 EUR 1%	-375,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148521	20.12.2029			1,308.23	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23)	375,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 EUR 1%	-375,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148602	20.12.2027			-33,680.18	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SENIOR	1,800,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 EUR 1%	-1,800,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS148707	20.06.2028			-17,452.85	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.28 EUR Societe Generale SRO LAC	2,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.28 EUR 1%	-2,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS149065	20.06.2027			-61,429.31	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.27 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SUB	4,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.27 EUR 1%	-4,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS149154	20.12.2029			8,088.05	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	245,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 JPY 1%	-245,000,000.00	JPY	1.0000		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Kupon	Unrealisiertes Ergebnis	Gegenpartei
	Nominale 1 Nominale 2	Whg 2	in %	in EUR	
Credit Default Swaps					
SWAPCDS149214	20.12.2025			-6,697.05	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	108,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 JPY 1%	-108,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS149215	20.12.2027			-4,246.22	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	75,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 JPY 1%	-75,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS149216	20.12.2029			12,709.80	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	385,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 JPY 1%	-385,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS149250	20.12.2029			6,701.53	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	203,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 JPY 1%	-203,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS149364	20.12.2032			207,224.62	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.32 EUR INTESA SANPAOLO SPA 20.06.2022	2,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.32 EUR 1%	-2,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS149369	20.12.2032			207,224.62	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.32 EUR INTESA SANPAOLO SPA 20.06.2022	2,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.32 EUR 1%	-2,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS153010	20.06.2026			-64,980.61	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.26 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBL	4,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.26 EUR 1%	-4,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS153279	20.06.2028			-314,821.61	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 USD Tenet Healthcare Corp. DL-Notes 2001(01/31)	2,250,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 USD 5%	-2,250,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS153371	20.06.2028			-594,663.04	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 USD Tenet Healthcare Corp. DL-Notes 2001(01/31)	4,250,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 USD 5%	-4,250,000.00	USD	5.0000		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS153547	20.06.2033			761.47	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.33 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2020(25)	2,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.33 EUR 1%	-2,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS153917	20.06.2028			-775,104.38	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.28 EUR Cellnex Telecom S.A. EO-Med.-Term Notes 2016(16/24)	5,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.28 EUR 5%	-5,000,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS153921	20.06.2028			-310,041.75	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.28 EUR Cellnex Telecom S.A. EO-Med.-Term Notes 2016(16/24)	2,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.28 EUR 5%	-2,000,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS154042	20.12.2025			-35,177.64	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.25 EUR Societe Generale SRO LAC	4,250,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.25 EUR 1%	-4,250,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS154113	20.06.2026			-234,302.42	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.26 EUR Dufry One B.V. EO-Notes 2017(17/24)	3,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.26 EUR 5%	-3,000,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS154315	20.06.2026			-156,201.62	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.26 EUR Dufry One B.V. EO-Notes 2017(17/24)	2,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.26 EUR 5%	-2,000,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS154412	20.06.2026			-234,302.42	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.26 EUR Dufry One B.V. EO-Notes 2017(17/24)	3,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.26 EUR 5%	-3,000,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS155655	20.09.2027			-101,737.22	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.06.23/20.09.27 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31)	750,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.09.27 USD 5%	-750,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS156276	20.12.2028			184,305.04	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 EUR INTESA SANPAOLO SPA 20.06.2022	8,750,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 EUR 1%	-8,750,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Kupon	Unrealisiertes Ergebnis	Gegenpartei
	Nominale 1 Nominale 2	Whg 2	in %	in EUR	
Credit Default Swaps					
SWAPCDS156277	20.12.2028			89,519.59	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 EUR INTESA SANPAOLO SPA 20.06.2022	4,250,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 EUR 1%	-4,250,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS156278	20.12.2028			39,901.77	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 EUR INTESA SANPAOLO SPA 20.06.2022	2,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 EUR 1%	-2,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS156414	20.06.2025			-27,826.31	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.25 EUR Deutsche Post AG Medium Term Notes v.12(24)	3,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.25 EUR 1%	-3,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS156485	20.06.2025			-18,550.87	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.25 EUR Deutsche Post AG Medium Term Notes v.12(24)	2,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.25 EUR 1%	-2,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS156928	20.06.2026			-30,324.29	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.23/20.06.26 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBL	2,100,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.06.26 EUR 1%	-2,100,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS157219	20.06.2026			-29,963.28	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.09.23/20.06.26 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBL	2,075,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.06.26 EUR 1%	-2,075,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS157749	20.06.2026			-29,963.28	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.09.23/20.06.26 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBL	2,075,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.06.26 EUR 1%	-2,075,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS158782	20.06.2033			1,370.65	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.33 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR	4,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.33 EUR 1%	-4,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS158799	20.06.2026			-66,358.13	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.09.23/20.06.26 EUR BNP PARIBAS SRO LAC	5,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.06.26 EUR 1%	-5,000,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Kupon	Unrealisiertes Ergebnis	Gegenpartei
	Nominale 1 Nominale 2	Whg 2	in %	in EUR	
Credit Default Swaps					
SWAPCDS159184	20.03.2027			-73,128.16	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.09.23/20.03.27 EUR HSBC HOLDINGS PLC, Ref ID XSSNRREFOBL0	4,300,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.09.23/20.03.27 EUR 1%	-4,300,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS159871	20.12.2025			-70,355.27	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.25 EUR Societe Generale SRO LAC	8,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.25 EUR 1%	-8,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS160162	20.03.2027			-33,411.10	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.06.23/20.03.27 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S	2,125,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.03.27 EUR 1%	-2,125,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS160163	20.03.2029			-47,906.38	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 20.06.23/20.03.29 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S	3,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.03.29 EUR 1%	-3,000,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS160164	20.06.2026			-24,548.23	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.06.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR	1,700,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.06.26 EUR 1%	-1,700,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS161108	20.12.2028			115,715.13	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.28 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SUB	5,800,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.28 EUR 1%	-5,800,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS162522	20.12.2026			-3,784.96	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.23/20.12.26 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(25)	375,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.12.26 EUR 1%	-375,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS162523	20.12.2028			-1,056.13	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.23/20.12.28 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(25)	375,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.12.28 EUR 1%	-375,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS162753	20.06.2029			-96,524.46	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.12.23/20.06.29 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SENIOR	5,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.06.29 EUR 1%	-5,000,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Kupon	Unrealisiertes Ergebnis	Gegenpartei
	Nominale 1 Nominale 2	Whg 2	in %	in EUR	
Credit Default Swaps					
SWAPCDS163206	20.12.2025			-37,246.91	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.12.23/20.12.25 EUR SOCIETE GENERALE SRO SUB	4,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.12.25 EUR 1%	-4,500,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS164254	20.12.2032			412,376.99	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.12.23/20.12.32 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SUB	4,975,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.12.23/20.12.32 EUR 1%	-4,975,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS164923	20.06.2029			-723,455.05	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.29 EUR iTraxx Europe Crossover Ser.41 Index (5 Year)	10,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.29 EUR 5%	-10,000,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS164993	20.06.2029			-876,578.30	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.29 EUR Cellnex Telecom S.A. EO-Med.-Term Notes 2017(17/25)	5,000,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.29 EUR 5%	-5,000,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS164994	20.03.2028			-42,465.01	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.03.24/20.03.28 EUR Societe Generale SRO LAC	4,800,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.03.28 EUR 1%	-4,800,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS165217	20.06.2026			-78,698.74	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.26 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR	5,450,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.26 EUR 1%	-5,450,000.00	EUR	1.0000		
SWAPCDS165324	20.06.2029			-477,676.24	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.29 USD CDX NA HY Series 42 V1 Index (5 Years)	8,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.29 USD 5%	-8,000,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS167104	20.09.2027			-67,676.73	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.09.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65	1,050,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.09.27 JPY 1%	-1,050,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS167398	20.06.2029			202,181.93	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.29 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2018(18/28)	6,500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.29 USD 1%	-6,500,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS167419	20.06.2029			-242,537.85	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.29 USD Post Holdings Inc. DL-Notes 2019(19/29) 144A	1,600,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.29 USD 5%	-1,600,000.00	USD	5.0000		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Kupon	Unrealisiertes Ergebnis	Gegenpartei
	Nominale 1	Whg 2	in %	in EUR	
	Nominale 2				
Credit Default Swaps					
SWAPCDS167445	20.06.2029			202,181.93	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.29 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2018(18/28)	6,500,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.29 USD 1%	-6,500,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS167502	20.09.2028			-282,573.57	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.09.28 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	1,800,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.09.28 USD 5%	-1,800,000.00	USD	5.0000		
SWAPCDS167504	20.06.2029			93,314.74	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.29 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2018(18/28)	3,000,000.00	USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.29 USD 1%	-3,000,000.00	USD	1.0000		
SWAPCDS167520	20.06.2029			-262,973.49	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Reference Asset 20.03.24/20.06.29 EUR Cellnex Telecom S.A. EO-Med.-Term Notes 2017(17/25)	1,500,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.06.29 EUR 5%	-1,500,000.00	EUR	5.0000		
SWAPCDS167572	20.03.2027			57,382.40	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 21.03.24/20.03.27 JPY Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2017(27) No. 9	320,000,000.00	JPY			
CDS Gebührenleg 21.03.24/20.03.27 JPY 1%	-320,000,000.00	JPY	1.0000		
SWAPCDS167579	20.12.2025			-35,177.64	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.12.25 EUR Societe Generale SRO LAC	4,250,000.00	EUR			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.12.25 EUR 1%	-4,250,000.00	EUR	1.0000		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2024

Swaps zum 30.06.2024

Bezeichnung	Fälligkeit		Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
	Nominale 1	Nominale 2				
Credit Default Swaps						
SWAPCDS167582		20.03.2027			28,691.20	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Reference Asset 21.03.24/20.03.27 JPY Rakuten Group Inc. YN-Bonds 2017(27) No. 9	160,000,000.00		JPY			
CDS Gebührenleg 21.03.24/20.03.27 JPY 1%	-160,000,000.00		JPY	1.0000		
SWAPCDS167651		20.09.2028			-285,713.28	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.24/20.09.28 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	1,820,000.00		USD			
CDS Gebührenleg 20.03.24/20.09.28 USD 5%	-1,820,000.00		USD	5.0000		
Credit Default Swaps gesamt					-5,189,945.30	
Swaps gesamt					-1,902,837.25	
Derivate gesamt					-4,354,291.38	

*) Für diese Swaps gibt es keinen aktuellen Basiswert. In diesem Fall wird daher das Notional im Sinne der CESR-Leitlinie 10-788 für die Berechnung der Verpflichtung verwendet.

XAIA Credit Debt Capital

XAIA Credit Debt Capital (I) Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Teilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres
2022	Stück	38,641.128	EUR	39,468,003.92	EUR 1,021.40
2023	Stück	47,857.308	EUR	49,218,527.37	EUR 1,028.44
30.06.2024	Stück	56,992.178	EUR	60,048,102.28	EUR 1,053.62

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	47,857.308
Ausgegebene Anteile	10,111.000
Zurückgenommene Anteile	-976.130
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	56,992.178

XAIA Credit Debt Capital

XAIA Credit Debt Capital (P) Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Teilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2022	Stück	39,664.049	EUR	3,950,855.92	EUR	99.61
2023	Stück	40,388.078	EUR	4,049,622.04	EUR	100.27
30.06.2024	Stück	61,148.311	EUR	6,265,076.73	EUR	102.46

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	40,388.078
Ausgegebene Anteile	23,287.865
Zurückgenommene Anteile	-2,527.632
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	61,148.311

XAIA Credit Debt Capital

XAIA Credit Debt Capital (V) Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres	Teilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres
2022	Stück 456,840.240	EUR 45,966,342.73	EUR 100.62
2023	Stück 206,340.870	EUR 20,911,267.53	EUR 101.34
30.06.2024	Stück 113,879.095	EUR 11,821,642.80	EUR 103.81

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	206,340.870
Ausgegebene Anteile	434.107
Zurückgenommene Anteile	-92,895.882
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	113,879.095

XAIA Credit Debt Capital

XAIA Credit Debt Capital (IT) Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres	Teilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres
2022	Stück 134,910.561	EUR 156,434,188.92	EUR 1,159.54
2023	Stück 142,901.561	EUR 174,376,671.66	EUR 1,220.26
30.06.2024	Stück 136,220.561	EUR 170,306,387.58	EUR 1,250.23

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	142,901.561
Ausgegebene Anteile	2,969.000
Zurückgenommene Anteile	-9,650.000
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	136,220.561

XAIA Credit Debt Capital

XAIA Credit Debt Capital (R) Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres	Teilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres
2022	Stück 29,777.000	EUR 2,980,242.17	EUR 100.09
2023	Stück 38,918.000	EUR 3,919,936.40	EUR 100.72
30.06.2024	Stück 159,345.000	EUR 16,436,726.81	EUR 103.15

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	38,918.000
Ausgegebene Anteile	123,579.000
Zurückgenommene Anteile	-3,152.000
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	159,345.000

XAIA Credit

Anlagen

Anlage 1: Allgemeine Angaben

Risikokennzahlen

XAIA Credit - XAIA Credit Debt Capital

Marktrisiko

Die zur Messung und Überwachung des Gesamtrisikos herangezogene Methode ist der absolute Value-at-Risk Ansatz (VaR) gemäß European Securities and Markets Authority (ESMA) - Leitlinie 10-788. Zur Berechnung des VaR wurde die historische Simulation angewendet. Dabei bezieht sich der VaR auf eine Haltedauer von einem Tag, bei einem Konfidenzniveau von 99% sowie einen Beobachtungszeitraum von mindestens einem Jahr. Die Auslastung berechnet sich als Quotient aus dem VaR des Portfolios und dem maximal zulässigen Wert (2,200%).

Für den Betrachtungszeitraum vom 1. Januar 2024 bis zum 30. Juni 2024 wurden folgende Kennzahlen ermittelt:

Name	Marktrisikomessansatz	Limit	Niedrigste Auslastung	Höchste Auslastung	Durchschnittliche Auslastung	Auslastung (30.06.2024)
XAIA Credit - XAIA Credit Debt Capital	Absoluter VaR	2,200%	9,46%	13,39%	11,50%	9,46%

Grad der Hebelwirkung

Im Betrachtungszeitraum wurde ein Grad der Hebelwirkung von durchschnittlich 213,16% gemessen, wobei im Allgemeinen ein Grad der Hebelwirkung von 200,00% erwartet wird. Die Berechnung beruht auf der in der European Securities and Markets Authority (ESMA) - Leitlinie 10-788 definierten Sum-of-Notionals Methode. In diesem Zusammenhang ist ein Grad der Hebelwirkung von 0% als ungehebeltes Portfolio zu verstehen.

XAIA Credit - XAIA Credit Basis

Marktrisiko

Die zur Messung und Überwachung des Gesamtrisikos herangezogene Methode ist der absolute Value-at-Risk Ansatz (VaR) gemäß European Securities and Markets Authority (ESMA) - Leitlinie 10-788. Zur Berechnung des VaR wurde die historische Simulation angewendet. Dabei bezieht sich der VaR auf eine Haltedauer von einem Tag, bei einem Konfidenzniveau von 99% sowie einen Beobachtungszeitraum von mindestens einem Jahr. Die Auslastung berechnet sich als Quotient aus dem VaR des Portfolios und dem maximal zulässigen Wert (2,200%).

Für den Betrachtungszeitraum vom 1. Januar 2024 bis zum 30. Juni 2024 wurden folgende Kennzahlen ermittelt:

Name	Marktrisikomessansatz	Limit	Niedrigste Auslastung	Höchste Auslastung	Durchschnittliche Auslastung	Auslastung (30.06.2024)
XAIA Credit - XAIA Credit Basis	Absoluter VaR	2,200%	10,57%	13,18%	12,05%	10,57%

Grad der Hebelwirkung

Im Betrachtungszeitraum wurde ein Grad der Hebelwirkung von durchschnittlich 257,13% gemessen, wobei im Allgemeinen ein Grad der Hebelwirkung von 220,00% erwartet wird. Die Berechnung beruht auf der in der European Securities and Markets Authority (ESMA) - Leitlinie 10-788 definierten Sum-of-Notionals Methode. In diesem Zusammenhang ist ein Grad der Hebelwirkung von 0% als ungehebeltes Portfolio zu verstehen.

XAIA Credit

Anlagen

Anlage 1: Allgemeine Angaben

Risikokennzahlen

XAIA Credit - XAIA Credit Basis II

Marktrisiko

Die zur Messung und Überwachung des Gesamtrisikos herangezogene Methode ist der absolute Value-at-Risk Ansatz (VaR) gemäß European Securities and Markets Authority (ESMA) - Leitlinie 10-788. Zur Berechnung des VaR wurde die historische Simulation angewendet. Dabei bezieht sich der VaR auf eine Haltedauer von einem Tag, bei einem Konfidenzniveau von 99% sowie einen Beobachtungszeitraum von mindestens einem Jahr. Die Auslastung berechnet sich als Quotient aus dem VaR des Portfolios und dem maximal zulässigen Wert (2,200%).

Für den Betrachtungszeitraum vom 1. Januar 2024 bis zum 30. Juni 2024 wurden folgende Kennzahlen ermittelt:

Name	Marktrisikomessansatz	Limit	Niedrigste Auslastung	Höchste Auslastung	Durchschnittliche Auslastung	Auslastung (30.06.2024)
XAIA Credit - XAIA Credit Basis II	Absoluter VaR	2,200%	9,72%	12,04%	10,93%	9,72%

Grad der Hebelwirkung

Im Betrachtungszeitraum wurde ein Grad der Hebelwirkung von durchschnittlich 247,15% gemessen, wobei im Allgemeinen ein Grad der Hebelwirkung von 250,00% erwartet wird. Die Berechnung beruht auf der in der European Securities and Markets Authority (ESMA) - Leitlinie 10-788 definierten Sum-of-Notionals Methode. In diesem Zusammenhang ist ein Grad der Hebelwirkung von 0% als ungehebeltes Portfolio zu verstehen.

XAIA Credit

Anlagen

Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft

Nachfolgend sind die Angaben zur Mitarbeitervergütung (Stand 30. September 2023) aufgeführt:

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der Gesellschaft gezahlten Mitarbeitervergütung	18,25 Mio. EUR
- davon feste Vergütung	17,05 Mio. EUR
- davon variable Vergütung	1,20 Mio. EUR
Zahl der Mitarbeiter der Gesellschaft	158,54 Vollzeitäquivalent
Höhe des gezahlten Carried Interest	n/a
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der Gesellschaft gezahlten Vergütung an Risktaker	3,78 Mio. EUR
- davon Führungskräfte	2,97 Mio. EUR
- davon andere Risktaker	0,81 Mio. EUR

Das Vergütungssystem der Verwaltungsgesellschaft ist auf der Homepage der Universal-Investment-Gesellschaft mbH unter <http://www.universal-investment.com/de/permanent-seiten/profil/luxemburg/regulatorische-informationen/verguetungssystem-luxemburg> sowie im Verkaufsprospekt zu finden.

Der Vergütungsausschuss überprüft einmal im Jahr die Einhaltung der Vergütungspolitik. Dies beinhaltet die Ausrichtung an der Geschäftsstrategie, den Zielen, Werten und Interessen der Universal-Investment-Luxembourg S.A. bzw. der von ihr verwalteten Fonds sowie Maßnahmen zur Vermeidung von Interessenkonflikten. Es ergaben sich keine Feststellungen, die eine Anpassung erfordert hätten.

Gegenüber dem Vorjahr wurde keine Änderung des Vergütungssystems vorgenommen.

Vergütungspolitik des Portfoliomanagers

Nachfolgend sind die Angaben zur Mitarbeitervergütung (Stand 31. Dezember 2023) aufgeführt:

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der Gesellschaft gezahlten Mitarbeitervergütung	1.4 Mio. EUR
Zahl der Mitarbeiter der Gesellschaft	12 Vollzeitäquivalent

Hinweis: Die Geschäftsführung erhält von der XAIA Investment ein Gehalt von 0,00 EUR. Die Gesellschafterin XAIA AG vergütet die GFs in Ihrer Funktion als Vorstände der XAIA AG. Die XAIA Investment legt die Gehälter der XAIA AG im Rahmen eines größeren Leistungspakets um.

XAIA Credit

Anlagen

Anlage 2: Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 - Ausweis nach Abschnitt A

XAIA Credit Debt Capital

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften

Wertpapierpensionsgeschäfte

		Pensionsgeschäfte	
Ertrags- und Kostenanteile			
Ertragsanteil des Fonds			
	absolut	EUR	0.00 *)
	in % der Bruttoerträge		0.00
Kostenanteil des Fonds			
		EUR	0.00
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft			
	absolut	EUR	0.00
	in % der Bruttoerträge		0.00
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft			
		EUR	0.00
Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent)			
	absolut	EUR	0.00
	in % der Bruttoerträge		0.00
Kostenanteil Dritter			
		EUR	0.00
Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps (absoluter Betrag)			
		EUR	0.00

Angaben gemäß den ESMA-Leitlinien ESMA/2014/937

*) Aufteilung der Kosten und Erträge pro Gegenpartei:

Barclays Bank Ireland PLC (G) (V) - Dublin	EUR	0.00
--	-----	------

XAIA Credit

Anlagen

Anlage 2: Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 - Ausweis nach Abschnitt A

XAIA Credit Basis

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften

Wertpapierpensionsgeschäfte

		Pensionsgeschäfte	
Ertrags- und Kostenanteile			
Ertragsanteil des Fonds	absolut	EUR	0.00 *)
	in % der Bruttoerträge		0.00
Kostenanteil des Fonds		EUR	0.00
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft	absolut	EUR	0.00
	in % der Bruttoerträge		0.00
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft		EUR	0.00
Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent)	absolut	EUR	0.00
	in % der Bruttoerträge		0.00
Kostenanteil Dritter		EUR	0.00
Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps (absoluter Betrag)		EUR	0.00

Angaben gemäß den ESMA-Leitlinien ESMA/2014/937 (ungeprüft)

*) Aufteilung der Kosten und Erträge pro Gegenpartei:

J.P. Morgan SE (GD) Frankfurt (V)	EUR	0.00
-----------------------------------	-----	------

XAIA Credit

Anlagen

Anlage 2: Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 - Ausweis nach Abschnitt A

XAIA Credit Basis II

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften

Wertpapierpensionsgeschäfte

		Pensionsgeschäfte	
Ertrags- und Kostenanteile			
Ertragsanteil des Fonds	absolut	EUR	0.00 *)
	in % der Bruttoerträge		0.00
Kostenanteil des Fonds		EUR	0.00
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft	absolut	EUR	0.00
	in % der Bruttoerträge		0.00
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft		EUR	0.00
Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent)	absolut	EUR	0.00
	in % der Bruttoerträge		0.00
Kostenanteil Dritter		EUR	0.00
Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps (absoluter Betrag)		EUR	0.00

Angaben gemäß den ESMA-Leitlinien ESMA/2014/937

*) Aufteilung der Kosten und Erträge pro Gegenpartei:

Barclays Bank Ireland PLC (G) (V) - Dublin	EUR	0.00
JP Morgan Securities plc (OTC) (G) London (V)	EUR	0.00

XAIA Credit

Anlagen

Anlage 3: Angaben gemäß Verordnung (EU) 2019/2088 über die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken in den Investmentprozess

XAIA Credit Basis

Konventionelles Produkt Artikel 6 der Verordnung (EU) 2019/2088 (Offenlegungs-Verordnung)

Dieser (Teil-)Fonds wird weder als ein Produkt eingestuft, das ökologische oder soziale Merkmale im Sinne der Offenlegungs-Verordnung (Artikel 8) bewirbt, noch als ein Produkt, das nachhaltige Investitionen zum Ziel hat (Artikel 9). Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

XAIA Credit Basis II und XAIA Credit Debt Capital

Artikel 8 Offenlegungs-Verordnung (Finanzprodukte, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben)

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impacts „PAI“) werden im Investitionsprozess auf Gesellschaftsebene (UIL: ManCo/AIFM) nicht berücksichtigt, weil die Gesellschaft (UIL: die ManCo / der AIFM) keine allgemeine fondsübergreifende Strategie für die Berücksichtigung der PAIs verfolgt.

Auch wenn auf Gesellschaftsebene keine PAIs berücksichtigt werden, sind Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren Bestandteil der Anlagestrategie des (Teil-)Fonds und es findet demnach eine verbindliche Berücksichtigung auf Fondsebene statt.

Weitere Informationen über die ökologischen und/oder sozialen Merkmale und zu der Berücksichtigung von den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren sind im Anhang "Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten" enthalten.

Der Grundsatz Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.