

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND CORP. EUR RESPONSIBLE

Jahresbericht per 29.02.2024

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

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

Rechnungswährung: EUR

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 27. Juni 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund V,

mit den Teilvermögen

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

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 29. Februar 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr¹, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

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



Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

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

¹ Erfolgsrechnungen für den Zeitraum vom 31. Oktober 2022 bis 29. Februar 2024 für die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible.

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 29. Februar 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	67
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	68
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	68
7	Pauschale Verwaltungskommission	69
8	Benchmark	69
9	TER	69
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	70
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	70
12	Fussnoten	70
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	71
14	Pflichtpublikationen	73

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.03.2023	01.03.2022	01.03.2021	01.03.2020
	bis	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022	28.02.2021
Konsolidiert					
	EUR				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		728'523'014.52	580'670'726.23	592'592'965.27	740'274'467.05
Klasse FA EUR					
	EUR				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		6'838'104.40	1'799'875.18	1'018'384.31	994'542.46
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		79'052.410	21'703.023	10'968.696	10'123.696
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		86.5009	82.9320	92.8446	98.2391
Ausschüttung je Anteil		1.50	1.25	1.20	1.40
Total Expense Ratio (TER)		0.20 %	0.20 %	0.20 %	0.20 %
Klasse NT EUR					
	EUR				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		697'809'132.97	555'957'328.51	568'301'617.33	717'074'499.11
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		5'864'430.726	4'928'974.378	4'546'978.436	5'480'048.997
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		118.9901	112.7937	124.9845	130.8518
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		113.3837	112.1119	128.7945	143.7868
Thesaurierung je Anteil		2.27	1.83	1.96	2.14
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NTH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in EUR)		23'875'777.15	22'913'522.54	23'272'963.63	22'205'425.48
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		259'121.194	267'304.701	252'318.701	246'025.678
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		87.8000	85.2024	95.0481	99.1786
Thesaurierung je Anteil (in EUR)		1.76	1.40	1.38	0.11
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse FA EUR	5.88 %	7.84 %	-13.78 %	-1.19 %
Klasse NT EUR	6.09 %	8.05 %	-13.61 %	-0.99 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 29.01.2021)	3.63 %	5.79 %	-14.05 %	-1.10 %
Benchmark Hedge	3.84 %	6.09 %	-	-
Benchmark	6.27 %	8.35 %	-14.09 %	-0.96 %
Tracking Error ³³⁾	0.16 %	0.17 %	0.29 %	0.05 %

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

Tracking Differenz

Klasse

Klasse FA EUR	-0.39 %
Klasse NT EUR	-0.18 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 29.01.2021)	-0.21 %

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	29.02.2024	28.02.2023
Bankguthaben auf Sicht	2'886'108.65	2'429'376.95
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	717'478'007.27	572'854'495.64
Sonstige Vermögenswerte	8'159'983.23	5'387'123.86
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	728'524'099.15	580'670'996.45
Andere Verbindlichkeiten	-1'084.63	-270.22
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	728'523'014.52	580'670'726.23

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse FA EUR	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		21'703.023	10'968.696
Ausgegebene Anteile		58'541.126	17'425.000
Zurückgenommene Anteile		-1'191.739	-6'690.673
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		79'052.410	21'703.023

Klasse NT EUR	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'928'974.378	4'546'978.436
Ausgegebene Anteile		1'225'009.134	1'215'530.746
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		382'653.493	242'851.509
Zurückgenommene Anteile		-213'749.246	-783'026.514
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-458'457.033	-293'359.799
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		5'864'430.726	4'928'974.378

Klasse NTH1 CHF	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		267'304.701	252'318.701
Ausgegebene Anteile		189.000	14'986.000
Zurückgenommene Anteile		-8'372.507	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		259'121.194	267'304.701

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT EUR	13.06.2023	1'064'673.13	9'316.209
Klasse NT EUR	13.06.2023	8'775'695.42	76'789.965
Klasse NT EUR	11.09.2023	2'944'590.64	25'773.335
Klasse NT EUR	07.12.2023	20'888'493.95	176'580.283
Klasse NT EUR	07.12.2023	4'577'023.08	38'691.733
Klasse NT EUR	12.01.2024	855'753.46	7'175.913
Klasse NT EUR	12.01.2024	5'763'056.03	48'326.055

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT EUR	26.06.2023	3'283'387.29	28'827.613
Klasse NT EUR	26.06.2023	13'710'600.48	120'376.870
Klasse NT EUR	18.09.2023	275'161.62	2'411.676
Klasse NT EUR	18.09.2023	1'284'948.53	11'262.034
Klasse NT EUR	20.12.2023	29'676'268.39	247'702.896
Klasse NT EUR	20.12.2023	5'735'820.56	47'875.944

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		580'670'726.23	592'592'965.27
Ausbezahlte Ausschüttung		-27'867.86	-23'926.44
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-3'467'753.13	-3'466'966.88
Saldo aus dem Anteilverkehr		111'298'280.67	50'606'046.26
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		40'049'628.61	-59'037'391.98
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		728'523'014.52	580'670'726.23

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		48'743.45	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-8'963.02
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		12'589'193.72	9'444'102.38
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		2'242'327.67	1'124'597.41
Total Ertrag		14'880'264.84	10'559'736.77
Aufwand			
Passivzinsen		-0.44	-0.92
Reglementarische Vergütungen		-7'863.64	-3'315.56
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-932'920.23	-1'088'132.95
Total Aufwand		-940'784.31	-1'091'449.43
Nettoertrag / Verlust		13'939'480.53	9'468'287.34
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-9'556'048.97	-11'955'148.16
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		724'460.66	594'537.77
Realisierter Erfolg		5'107'892.22	-1'892'323.05
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		34'941'736.39	-57'145'068.93
Gesamterfolg		40'049'628.61	-59'037'391.98

Verwendung des Erfolges

Klasse FA EUR	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	120'014.75	26'789.72
Vortrag des Vorjahres	727.83	1'066.89
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	120'742.58	27'856.61
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	118'578.62	27'128.78
Vortrag auf neue Rechnung	2'163.96	727.83
Total	120'742.58	27'856.61

Klasse NT EUR	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	13'361'008.96	9'067'053.95
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	13'361'008.96	9'067'053.95
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	4'676'353.14	3'173'468.88
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	8'684'655.82	5'893'585.07
Total	13'361'008.96	9'067'053.95

Klasse NTH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	458'456.82	374'443.67
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	458'456.82	374'443.67
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	160'459.89	131'055.28
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	297'996.93	243'388.39
Total	458'456.82	374'443.67

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							717'478'007.27	98.48	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							717'478'007.27	98.48	
AT0000A2GH08	0.8750 % ERSTBK 0 7/8 05/13/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2J645	1.6250 % ERSTBK 1 5/8 09/08/31 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2JAF6	0.0500 % ERSTBK 0.05 09/16/25 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2JAF6XXX	0.0500 % ERSTBK 0.05 09/16/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2KW37	0.1000 % ERSTBK 0.1 11/16/28 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2N837	0.2500 % ERSTBK 0 1/4 01/27/31 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2RAA0	0.1250 % ERSTBK 0 1/8 05/17/28 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2STV4	0.5000 % CESSPO 0 1/2 09/13/28 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2SUH1	0.2500 % ERSTBK 0 1/4 09/14/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2U543	0.8750 % ERSTBK 0 7/8 11/15/32 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2YA29	4.0000 % ERSTBK 4 06/07/33 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A32562	4.0000 % ERSTBK 4 01/16/31	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A32HA3	4.0000 % HYN0E 4 02/01/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.69%	199'388.00	0.03	a)
AT0000A34QR4	4.2500 % ERSTBK 4 1/4 05/30/30 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT000B122080	0.8750 % VOWIBA 0 7/8 03/23/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.46%	186'926.00	0.03	a)
AT000B122155	4.7500 % VOWIBA 4 3/4 03/15/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.00%	204'006.00	0.03	a)
BE0002237064	1.8750 % PROXBB 1 7/8 10/01/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.08%	194'164.00	0.03	a)
BE0002251206	3.1250 % CCBGBB 3 1/8 05/11/26	300	0	0	300 EUR	97.55%	292'662.00	0.04	a)
BE0002290592	1.6250 % KBCBB 1 5/8 09/18/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0002470459	2.8750 % FLUVIU 2 7/8 05/07/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.42%	192'836.00	0.03	a)
BE0002601798	1.2500 % BPOST 1 1/4 07/11/26	200	0	0	200 EUR	94.50%	189'004.00	0.03	a)
BE0002645266	0.6250 % KBCBB 0 5/8 04/10/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.58%	193'158.00	0.03	a)
BE0002664457	0.5000 % KBCBB 0 1/2 12/03/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0002681626	0.7500 % KBCBB 0 3/4 01/24/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.83%	169'660.00	0.02	a)
BE0002728096	0.1250 % KBCBB 0 1/8 09/10/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.32%	282'951.00	0.04	a)
BE0002755362	0.2500 % FLUVIU 0 1/4 12/02/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.30%	162'602.00	0.02	a)
BE0002766476	0.1250 % KBCBB 0 1/8 01/14/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	86.88%	260'634.00	0.04	a)
BE0002799808	0.7500 % KBCBB 0 3/4 05/31/31 EMTN	100	200	0	300 EUR	82.34%	247'005.00	0.03	a)
BE0002803840	0.2500 % FLUVIU 0 1/4 06/14/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	87.09%	87'091.00	0.01	a)
BE0002819002	0.6250 % KBCBB 0 5/8 12/07/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.37%	180'748.00	0.02	a)
BE0002830116	0.7500 % PROXBB 0 3/4 11/17/36 EMTN	200	100	0	300 EUR	70.65%	211'944.00	0.03	a)
BE0002831122	0.6250 % FLUVIU 0 5/8 11/24/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	79.88%	159'750.00	0.02	a)
BE0002832138	0.2500 % KBCBB 0 1/4 03/01/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.24%	186'470.00	0.03	a)
BE0002839208	0.7500 % KBCBB 0 3/4 01/21/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.79%	183'580.00	0.03	a)
BE0002846278	1.5000 % KBCBB 1 1/2 03/29/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.38%	194'758.00	0.03	a)
BE0002871524	4.0000 % FLUVIU 4 07/06/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	102.13%	204'260.00	0.03	a)
BE0002875566	3.0000 % KBCBB 3 08/25/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.38%	190'764.00	0.03	a)
BE0002900810	4.3750 % KBCBB 4 3/8 11/23/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	101.50%	304'506.00	0.04	a)
BE0002913946	5.7500 % CRELAN 5 3/4 01/26/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	104.14%	104'144.00	0.01	a)
BE0002914951	4.8750 % KBCBB 4 7/8 04/25/33 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.62%	100'619.00	0.01	a)
BE0002925064	4.0000 % PROXBB 4 03/08/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.51%	205'012.00	0.03	a)
BE0002935162	4.3750 % KBCBB 4 3/8 04/19/30 EMTN	0	400	0	400 EUR	101.86%	407'428.00	0.06	a)
BE0002936178	6.0000 % CRELAN 6 02/28/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	105.79%	211'572.00	0.03	a)
BE0002939206	3.8750 % FLUVIU 3 7/8 05/09/33	0	200	0	200 EUR	100.60%	201'200.00	0.03	a)
BE0002950310	4.5000 % KBCBB 4 1/2 06/06/26 EMTN	0	400	0	400 EUR	100.53%	402'132.00	0.06	a)
BE0002951326	4.3750 % KBCBB 4 3/8 12/06/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.64%	207'284.00	0.03	a)
BE0002963446	4.1250 % CCBGBB 4 1/8 09/12/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	102.34%	307'023.00	0.04	a)
BE0002964451	3.8750 % FLUVIU 3 7/8 03/18/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.48%	101'482.00	0.01	a)
BE0002977586	4.1250 % PROXBB 4 1/8 11/17/33 EMTN	0	300	0	300 EUR	103.82%	311'463.00	0.04	a)
BE0002989706	5.2500 % CRELAN 5 1/4 01/23/32	0	300	0	300 EUR	101.07%	303'213.00	0.04	a)
BE0002990712	4.7500 % KBCBB 4 3/4 04/17/35 EMTN	0	400	0	400 EUR	99.46%	397'848.00	0.05	a)
BE0974365976	0.3750 % KBCBB 0 3/8 06/16/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.73%	92'731.00	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
BE6243179650	2.8750 % ABIBB 2 7/8 09/25/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6248644013	3.2500 % ABIBB 3 1/4 01/24/33 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6265142099	2.7000 % ABIBB 2 7/8 03/31/26 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6265262327	2.3750 % PROXBB 2 3/8 04/04/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6276040431	1.5000 % ABIBB 1 1/2 04/18/30 EMTN	450	0	450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6282460615	2.7500 % SYENS 2 3/4 12/02/27	200	0	0	200 EUR	96.73%	193'458.00	0.03	a)
BE6285455497	2.0000 % ABIBB 2 03/17/28 EMTN	780	0	780	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6285457519	2.7500 % ABIBB 2 3/4 03/17/36 EMTN	791	0	791	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6301510028	1.1500 % ABIBB 1.15 01/22/27 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6301511034	2.0000 % ABIBB 2 01/23/35 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6311694010	1.0000 % ARGSPA 1 02/06/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6312821612	1.1250 % ABIBB 1 1/8 07/01/27 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6312822628	1.6500 % ABIBB 1.65 03/28/31 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6315719490	0.0000 % CCBGBB 0 08/28/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.40%	182'808.00	0.03	a)
BE6318702253	1.0000 % ARGSPA 1 01/29/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.24%	182'476.00	0.03	a)
BE6320934266	2.1250 % ABIBB 2 1/8 12/02/27 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6320935271	2.8750 % ABIBB 2 7/8 04/02/32 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6320936287	3.7000 % ABIBB 3.7 04/02/40 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6321076711	1.6250 % LONNVX 1 5/8 04/21/27	200	0	0	200 EUR	94.18%	188'358.00	0.03	a)
BE6322991462	0.1250 % EUROCL 0 1/8 07/07/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.42%	190'834.00	0.03	a)
BE6324012978	0.3750 % CCBGBB 0 3/8 09/02/25	200	0	0	200 EUR	95.09%	190'176.00	0.03	a)
BE6324720299	0.0100 % CCBGBB 0.01 10/15/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.03%	188'050.00	0.03	a)
BE6325493268	0.8750 % COFBBB 0 7/8 12/02/30	200	0	0	200 EUR	79.27%	158'536.00	0.02	a)
BE6326784566	0.1250 % CCBGBB 0 1/8 02/08/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.70%	175'398.00	0.02	a)
BE6328785207	0.3750 % CCBGBB 0 3/8 06/08/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.79%	89'790.00	0.01	a)
BE6330288687	0.7500 % AEDBB 0 3/4 09/09/31	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE6331190973	1.2500 % CCBGBB 1 1/4 04/06/34 EMTN	100	0	0	100 EUR	83.62%	83'616.00	0.01	a)
BE6331562817	0.8750 % ALIVP 0 7/8 11/08/28	300	0	0	300 EUR	86.16%	258'486.00	0.04	a)
BE6333133039	1.3750 % ARGSPA 1 3/8 02/08/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.17%	178'348.00	0.02	a)
BE6334365713	1.1250 % ECLEAR 1 1/8 12/07/26	300	0	0	300 EUR	94.16%	282'468.00	0.04	a)
BE6338167909	3.6250 % EUROCL 3 5/8 10/13/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.53%	201'064.00	0.03	a)
BE6339428904	5.3750 % ARGSPA 5 3/8 11/29/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.55%	205'106.00	0.03	a)
BE6340794013	5.2500 % CCBGBB 5 1/4 04/19/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.17%	202'330.00	0.03	a)
BE6343825251	3.8750 % LONNVX 3 7/8 05/25/33	0	200	0	200 EUR	100.79%	201'574.00	0.03	a)
BE6344187966	3.8750 % CCBGBB 3 7/8 06/12/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.02%	202'032.00	0.03	a)
CH0314209351	2.1250 % UBS 2 1/8 03/04/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH0336602930	1.2500 % UBS 1 1/4 09/01/26 EMTN	600	0	0	600 EUR	94.25%	565'500.00	0.08	a)
CH0341440334	1.5000 % UBS 1 1/2 11/30/24	550	0	550	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH0343366842	1.2500 % UBS 1 1/4 07/17/25 EMTN	550	0	550	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606354	1.2500 % UBS 1 1/4 04/17/25	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH0483180946	1.0000 % UBS 1 06/24/27 EMTN	350	100	0	450 EUR	93.34%	420'030.00	0.06	a)
CH0494734418	0.6500 % UBS 0.65 09/10/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	84.29%	252'867.00	0.03	a)
CH0517825276	0.6500 % UBS 0.65 01/14/28 EMTN	200	160	0	360 EUR	91.05%	327'772.80	0.04	a)
CH0520042489	0.2500 % UBS 0 1/4 01/29/26 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH0537261858	3.2500 % UBS 3 1/4 04/02/26 EMTN	600	0	0	600 EUR	99.00%	594'012.00	0.08	a)
CH0576402181	0.2500 % UBS 0 1/4 11/05/28 EMTN	350	0	0	350 EUR	87.33%	305'658.50	0.04	a)
CH0591979627	0.6250 % UBS 0 5/8 01/18/33 EMTN	300	150	0	450 EUR	74.72%	336'231.00	0.05	a)
CH0595205524	0.2500 % UBS 0 1/4 02/24/28	300	0	0	300 EUR	87.39%	262'179.00	0.04	a)
CH0595205532	0.6250 % UBS 0 5/8 02/24/33	400	0	0	400 EUR	75.00%	299'984.00	0.04	a)
CH1120418079	0.0000 % BAER 0 06/25/24	200	0	0	200 EUR	98.73%	197'464.00	0.03	a)
CH1130818847	0.5000 % SLHNVX 0 1/2 09/15/31	150	0	0	150 EUR	79.27%	118'902.00	0.02	a)
CH1142231682	0.2500 % UBS 0 1/4 11/03/26	200	0	0	200 EUR	93.98%	187'962.00	0.03	a)
CH1142231690	0.8750 % UBS 0 7/8 11/03/31	400	0	0	400 EUR	80.30%	321'184.00	0.04	a)
CH1168499791	1.0000 % UBS 1 03/21/25 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1174335732	2.1250 % UBS 2 1/8 10/13/26	700	0	0	700 EUR	97.06%	679'399.00	0.09	a)
CH1174335740	2.8750 % UBS 2 7/8 04/02/32	500	0	0	500 EUR	92.50%	462'495.00	0.06	a)
CH1194000340	2.7500 % UBS 2 3/4 06/15/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.29%	291'879.00	0.04	a)
CH1194000357	3.1250 % UBS 3 1/8 06/15/30 EMTN	350	0	0	350 EUR	96.04%	336'129.50	0.05	a)
CH1210198136	3.2500 % SLHNVX 3 1/4 08/31/29	200	0	0	200 EUR	98.10%	196'202.00	0.03	a)
CH1214797172	7.7500 % UBS 7 3/4 03/01/29	1'000	300	400	900 EUR	113.25%	1'019'259.00	0.14	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
CH1224575899	5.2300 % RAIFFS 5.23 11/01/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1236363391	4.3750 % UBS 4 3/8 01/11/31 EMTN	0	250	0	250 EUR	101.65%	254'117.50	0.03 a)	
CH1251998238	4.8400 % RAIFFS 4.84 11/03/28 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
CH1255915006	4.6250 % UBS 4 5/8 03/17/28 EMTN	0	600	0	600 EUR	101.70%	610'182.00	0.08 a)	
CH1255915014	4.7500 % UBS 4 3/4 03/17/32 EMTN	0	350	0	350 EUR	103.74%	363'093.50	0.05 a)	
CH1266847149	4.1560 % ZKB 4.156 06/08/29	0	200	0	200 EUR	101.91%	203'816.00	0.03 a)	
CH1290222392	4.4670 % ZKB 4.467 09/15/27	0	200	0	200 EUR	101.36%	202'720.00	0.03 a)	
CH1305916897	4.1250 % UBS 4 1/8 06/09/33	0	200	0	200 EUR	99.54%	199'084.00	0.03 a)	
DE000A11QSB8	1.8750 % MBGGR 1 7/8 07/08/24 EMTN	150	0	0	150 EUR	99.31%	148'962.00	0.02 a)	
DE000A13R7Z7	3.3750 % ALVGR 3 3/8 PERP	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A13SL34	1.7500 % SAPGR 1 3/4 02/22/27 EMTN	450	0	0	450 EUR	97.75%	439'884.00	0.06 a)	
DE000A14J9N8	2.2410 % ALVGR 2.241 07/07/45	400	0	0	400 EUR	97.05%	388'184.00	0.05 a)	
DE000A14KJF5	1.0000 % SAPGR 1 04/01/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.41%	97'409.00	0.01 a)	
DE000A169NC2	1.3750 % MBGGR 1 3/8 05/11/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	92.49%	369'960.00	0.05 a)	
DE000A180B80	1.3750 % ALVGR 1 3/8 04/21/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.44%	268'329.00	0.04 a)	
DE000A182VT2	1.5000 % ANNGR 1 1/2 06/10/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A185QA5	0.3750 % EVKGR 0 3/8 09/07/24 EMTN	250	0	0	250 EUR	98.20%	245'505.00	0.03 a)	
DE000A185QB3	0.7500 % EVKGR 0 3/4 09/07/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.10%	180'204.00	0.02 a)	
DE000A188WW1	0.7500 % BASGR 0 3/4 11/10/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.21%	235'535.00	0.03 a)	
DE000A189ZX0	1.2500 % ANNGR 1 1/4 12/06/24 EMTN	500	0	0	500 EUR	97.99%	489'970.00	0.07 a)	
DE000A190NE4	1.0000 % MBGGR 1 11/11/25 EMTN	350	0	0	350 EUR	95.86%	335'503.00	0.05 a)	
DE000A1919G4	1.7500 % JABHOL 1 3/4 06/25/26	100	0	0	100 EUR	95.47%	95'466.00	0.01 a)	
DE000A1919H2	2.5000 % JABHOL 2 1/2 06/25/29 11Y	300	0	0	300 EUR	94.24%	282'717.00	0.04 a)	
DE000A194DD9	0.8750 % MBGGR 0 7/8 04/09/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A194DE7	1.5000 % MBGGR 1 1/2 02/09/27 EMTN	150	0	0	150 EUR	95.00%	142'504.50	0.02 a)	
DE000A198BE2	1.7500 % ANNGR 1 3/4 01/25/27 EMTN	400	500	0	900 EUR	94.38%	849'456.00	0.12 a)	
DE000A19HCX8	2.0000 % JABHOL 2 05/18/28	300	0	0	300 EUR	93.55%	280'650.00	0.04 a)	
DE000A19NS93	1.1250 % ANNGR 1 1/8 09/08/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A19S4V6	0.8750 % ALVGR 0 7/8 12/06/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.29%	276'876.00	0.04 a)	
DE000A19UR79	1.5000 % ANNGR 1 1/2 01/14/28	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A19X8A4	1.5000 % ANNGR 1 1/2 03/22/26 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A19X8C0	2.7500 % ANNGR 2 3/4 03/22/38 EMTN	300	0	0	300 EUR	82.20%	246'606.00	0.03 a)	
DE000A1HG1K6	3.0000 % ALVGR 3 03/13/28 61	200	500	0	700 EUR	99.31%	695'198.00	0.10 a)	
DE000A1UDWN5	2.8750 % SIEGR 2 7/8 03/10/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	99.02%	297'048.00	0.04 a)	
DE000A1Z0TA4	1.6250 % JABHOL 1 5/8 04/30/25	400	0	0	400 EUR	97.44%	389'768.00	0.05 a)	
DE000A1ZY989	1.5000 % ANNGR 1 1/2 03/31/25 DIP	160	0	160	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A1ZZ028	1.0000 % BMW 1 04/20/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	93.08%	372'332.00	0.05 a)	
DE000A254P51	0.8750 % LEGGR 0 7/8 11/28/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.02%	180'030.00	0.02 a)	
DE000A254TM8	2.1210 % ALVGR 2.121 07/08/50 EMTN	300	0	0	300 EUR	87.00%	260'991.00	0.04 a)	
DE000A287179	1.0000 % ANNGR 1 01/28/41 EMTN	200	0	0	200 EUR	58.15%	116'304.00	0.02 a)	
DE000A289DC9	0.2500 % BASGR 0 1/4 06/05/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.60%	181'196.00	0.02 a)	
DE000A289LU4	0.2500 % AARB 0 1/4 11/23/27 304	200	0	0	200 EUR	80.35%	160'706.00	0.02 a)	
DE000A289N78	1.2500 % DBOERS 1 1/4 06/16/47	200	0	0	200 EUR	91.15%	182'302.00	0.03 a)	
DE000A289NF1	1.5000 % DWNIGY 1 1/2 04/30/30	200	0	0	200 EUR	85.89%	171'788.00	0.02 a)	
DE000A289NX4	0.6250 % EVKGR 0 5/8 09/18/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.45%	190'898.00	0.03 a)	
DE000A289QR9	0.7500 % MBGGR 0 3/4 09/10/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.67%	171'342.00	0.02 a)	
DE000A289RN6	2.6250 % MBGGR 2 5/8 04/07/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.85%	296'535.00	0.04 a)	
DE000A289XG8	2.3750 % MBGGR 2 3/8 05/22/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.90%	189'800.00	0.03 a)	
DE000A289XJ2	2.0000 % MBGGR 2 08/22/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	96.96%	387'844.00	0.05 a)	
DE000A28RSQ8	0.0000 % ALVGR 0 01/14/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.91%	193'814.00	0.03 a)	
DE000A28RSR6	0.5000 % ALVGR 0 1/2 01/14/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	83.76%	167'514.00	0.02 a)	
DE000A28V301	2.5000 % JABHOL 2 1/2 04/17/27	200	0	0	200 EUR	96.39%	192'786.00	0.03 a)	
DE000A28V319	3.3750 % JABHOL 3 3/8 04/17/35	100	0	0	100 EUR	93.99%	93'986.00	0.01 a)	
DE000A28VQD2	2.2500 % ANNGR 2 1/4 04/07/30	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2AAL31	1.5000 % MBGGR 1 1/2 03/09/26 EMTN	450	0	0	450 EUR	96.50%	434'254.50	0.06 a)	
DE000A2BPA51	0.8750 % BASGR 0 7/8 10/06/31 EMTN	400	0	0	400 EUR	83.82%	335'260.00	0.05 a)	
DE000A2DADM7	0.8500 % MBGGR 0.85 02/28/25 EMTN	350	0	0	350 EUR	97.28%	340'462.50	0.05 a)	
DE000A2DAH6	3.0990 % ALVGR 3.099 07/06/47	300	0	0	300 EUR	96.56%	289'686.00	0.04 a)	
DE000A2G8VT5	1.0000 % SAPGR 1 03/13/26	300	0	0	300 EUR	95.64%	286'917.00	0.04 a)	
DE000A2G8VU3	1.3750 % SAPGR 1 3/8 03/13/30	0	100	0	100 EUR	90.62%	90'622.00	0.01 a)	
DE000A2GSCW3	1.5000 % MBGGR 1 1/2 07/03/29 EMTN	500	0	0	500 EUR	90.88%	454'380.00	0.06 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
DE000A2G5CX1	2.1250 % MBGGR 2 1/8 07/03/37 EMTN	450	0	0	450 EUR	86.85%	390'802.50	0.05	a)
DE000A2G5LY0	1.0000 % MBGGR 1 11/15/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.02%	276'069.00	0.04	a)
DE000A2LQ5M4	1.7500 % HOTGR 1 3/4 07/03/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.26%	243'152.50	0.03	a)
DE000A2LQJ75	1.1250 % DBOERS 1 1/8 03/26/28	250	0	0	250 EUR	92.21%	230'517.50	0.03	a)
DE000A2LQRS3	2.2500 % DT 2 1/4 03/29/39 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2R7JE1	1.1250 % ANNGR 1 1/8 09/14/34 EMTN	100	0	0	100 EUR	72.66%	72'662.00	0.01	a)
DE000A2R9ZU9	0.6250 % MBGGR 0 5/8 05/06/27 EMTN	200	200	0	400 EUR	91.92%	367'680.00	0.05	a)
DE000A2RWAX4	0.8750 % ALVGR 0 7/8 01/15/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.59%	191'180.00	0.03	a)
DE000A2RWAY2	1.5000 % ALVGR 1 1/2 01/15/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.94%	181'888.00	0.02	a)
DE000A2RYD91	1.3750 % MBGGR 1 3/8 06/26/26 EMTN	200	100	0	300 EUR	95.47%	286'416.00	0.04	a)
DE000A2SBDE0	1.0000 % JABHOL 1 12/20/27	100	0	0	100 EUR	90.57%	90'571.00	0.01	a)
DE000A2SBDF7	2.2500 % JABHOL 2 1/4 12/19/39	300	0	0	300 EUR	75.30%	225'912.00	0.03	a)
DE000A2TR083	2.0000 % MBGGR 2 02/27/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.78%	278'343.00	0.04	a)
DE000A2T5DE2	1.7500 % DT 1 3/4 03/25/31 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A2TSTEB	0.7500 % SAPGR 0 3/4 12/10/24	300	0	0	300 EUR	97.75%	293'253.00	0.04	a)
DE000A2TSTF5	1.2500 % SAPGR 1 1/4 03/10/28	300	0	0	300 EUR	93.08%	279'249.00	0.04	a)
DE000A2TSTG3	1.6250 % SAPGR 1 5/8 03/10/31	400	0	0	400 EUR	90.19%	360'748.00	0.05	a)
DE000A2YB7B5	2.8750 % SHAEFF 2 7/8 03/26/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.15%	194'306.00	0.03	a)
DE000A2YNZW8	0.3750 % MBGGR 0 3/8 11/08/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	92.57%	231'412.50	0.03	a)
DE000A2YNZX6	0.7500 % MBGGR 0 3/4 02/08/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	86.10%	215'260.00	0.03	a)
DE000A2YNZY4	1.1250 % MBGGR 1 1/8 08/08/34 EMTN	150	0	0	150 EUR	80.65%	120'969.00	0.02	a)
DE000A2YPFA1	1.3010 % ALVGR 1.301 09/25/49	300	0	0	300 EUR	85.06%	255'183.00	0.04	a)
DE000A2YPFU9	1.1250 % MBGGR 1 1/8 11/06/31 EMTN	350	0	0	350 EUR	84.77%	296'702.00	0.04	a)
DE000A30V5C3	5.3750 % DB 5 3/8 01/11/29	0	200	0	200 EUR	103.52%	207'036.00	0.03	a)
DE000A30VGD9	2.6250 % HERAEU 2 5/8 06/09/27	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A30VJZ6	4.2520 % ALVGR 4.252 07/05/52 EMTN	400	0	0	400 EUR	97.33%	389'328.00	0.05	a)
DE000A30VPL3	3.4500 % AMPRIO 3.45 09/22/27	0	200	0	200 EUR	99.28%	198'554.00	0.03	a)
DE000A30VPM1	3.9710 % AMPRIO 3.971 09/22/32	300	0	0	300 EUR	101.23%	303'690.00	0.04	a)
DE000A30VQ09	4.0000 % DB 4 11/29/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.75%	201'506.00	0.03	a)
DE000A30VQA4	4.7500 % ANNGR 4 3/4 05/23/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.95%	101'952.00	0.01	a)
DE000A30VQB2	5.0000 % ANNGR 5 11/23/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.64%	207'278.00	0.03	a)
DE000A30VT06	5.0000 % DB 5 09/05/30	300	0	0	300 EUR	102.24%	306'708.00	0.04	a)
DE000A30VTT8	4.5970 % ALVGR 4.597 09/07/38 EMTN	300	0	0	300 EUR	100.58%	301'728.00	0.04	a)
DE000A3514E6	3.8750 % AMPRIO 3 7/8 09/07/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.13%	202'250.00	0.03	a)
DE000A3514F3	4.1250 % AMPRIO 4 1/8 09/07/34 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.81%	203'610.00	0.03	a)
DE000A3515S3	4.3750 % HASPA 4 3/8 02/12/29	0	200	0	200 EUR	102.98%	205'954.00	0.03	a)
DE000A351U49	5.8240 % ALVGR 5.824 07/25/53	0	400	0	400 EUR	108.01%	432'040.00	0.06	a)
DE000A351ZR8	3.8750 % DBOERS 3 7/8 09/28/26	0	300	0	300 EUR	100.93%	302'802.00	0.04	a)
DE000A351ZS6	3.7500 % DBOERS 3 3/4 09/28/29	0	300	0	300 EUR	101.88%	305'649.00	0.04	a)
DE000A351ZT4	3.8750 % DBOERS 3 7/8 09/28/33	0	400	0	400 EUR	103.10%	412'404.00	0.06	a)
DE000A3823R3	4.5000 % SHAEFF 4 1/2 08/14/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.73%	201'452.00	0.03	a)
DE000A3823S1	4.7500 % SHAEFF 4 3/4 08/14/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.06%	101'060.00	0.01	a)
DE000A3826R6	3.7500 % DB 3 3/4 01/15/30	0	100	0	100 EUR	98.76%	98'761.00	0.01	a)
DE000A3E5FR9	0.6250 % ANNGR 0 5/8 03/24/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.21%	156'426.00	0.02	a)
DE000A3E5L98	0.2500 % EWE 0 1/4 06/08/28 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3E5MG8	0.3750 % ANNGR 0 3/8 06/16/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.18%	267'537.00	0.04	a)
DE000A3E5MH6	0.6250 % ANNGR 0 5/8 12/14/29 EMTN	500	0	0	500 EUR	81.84%	409'195.00	0.06	a)
DE000A3E5MJ2	1.0000 % ANNGR 1 06/16/33	300	0	0	300 EUR	73.60%	220'794.00	0.03	a)
DE000A3E5MK0	1.5000 % ANNGR 1 1/2 06/14/41	200	0	0	200 EUR	62.92%	125'846.00	0.02	a)
DE000A3E5QW6	0.1250 % GEVVOH 0 1/8 06/24/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.14%	176'286.00	0.02	a)
DE000A3E5S00	0.6250 % HOTGR 0 5/8 04/26/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.45%	168'906.00	0.02	a)
DE000A3E5VK1	0.7500 % LEGGR 0 3/4 06/30/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	77.48%	154'966.00	0.02	a)
DE000A3E5VX4	0.6250 % AMPRIO 0 5/8 09/23/33 EMTN	300	0	0	300 EUR	75.08%	225'237.00	0.03	a)
DE000A3H2457	0.0000 % DBOERS 0 02/22/26	200	0	0	200 EUR	93.74%	187'486.00	0.03	a)
DE000A3H2465	0.1250 % DBOERS 0 1/8 02/22/31	200	0	0	200 EUR	80.89%	161'778.00	0.02	a)
DE000A3H2TA0	3.3750 % SHAEFF 3 3/8 10/12/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.94%	191'884.00	0.03	a)
DE000A3H2TW4	0.3750 % EWE 0 3/8 10/22/32 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3H3GE7	0.0000 % HOWOGE 0 11/01/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.34%	194'686.00	0.03	a)
DE000A3H3GF4	0.6250 % HOWOGE 0 5/8 11/01/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.24%	174'478.00	0.02	a)
DE000A3H3GG2	1.1250 % HOWOGE 1 1/8 11/01/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	77.25%	154'504.00	0.02	a)
DE000A3H3J14	0.0000 % VANTOW 0 03/31/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
DE000A3H3J22	0.3750 % VANTOW 0 3/8 03/31/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3H3J30	0.7500 % VANTOW 0 3/4 03/31/30 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000A3H3JM4	0.7500 % MBGGR 0 3/4 03/11/33 EMTN	200	100	0	300 EUR	79.76%	239'265.00	0.03 a)	
DE000A3H3JU7	0.8750 % LEGGR 0 7/8 03/30/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	74.19%	148'376.00	0.02 a)	
DE000A3K5HW7	4.7500 % JABHOL 4 3/4 06/29/32	200	0	0	200 EUR	104.77%	209'538.00	0.03 a)	
DE000A3KNP88	0.1250 % TRAGR 0 1/8 03/24/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.94%	191'876.00	0.03 a)	
DE000A3KNP96	0.7500 % TRAGR 0 3/4 03/24/29 EMTN	0	400	0	400 EUR	86.37%	345'476.00	0.05 a)	
DE000A3KNQA0	1.2500 % TRAGR 1 1/4 03/24/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	79.42%	158'848.00	0.02 a)	
DE000A3KY342	0.0000 % ALVGR 0 11/22/26	200	0	0	200 EUR	91.81%	183'618.00	0.03 a)	
DE000A3KY359	0.5000 % ALVGR 0 1/2 11/22/33	100	0	0	100 EUR	77.49%	77'491.00	0.01 a)	
DE000A3LBGG1	4.1250 % TRAGR 4 1/8 11/22/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.30%	200'604.00	0.03 a)	
DE000A3LBMV2	3.0000 % MBGGR 3 02/23/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	99.05%	297'135.00	0.04 a)	
DE000A3LH6T7	3.5000 % MBGGR 3 1/2 05/30/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.10%	300'288.00	0.04 a)	
DE000A3LH6U5	3.7000 % MBGGR 3 7/8 05/30/31 EMTN	0	300	0	300 EUR	102.58%	307'743.00	0.04 a)	
DE000A3LHK72	4.0000 % TRAGR 4 09/16/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.01%	200'010.00	0.03 a)	
DE000A3LHK80	4.2500 % TRAGR 4 1/4 05/16/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.39%	304'179.00	0.04 a)	
DE000A3LQ9S2	4.5000 % TRAGR 4 1/2 11/23/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.61%	304'830.00	0.04 a)	
DE000A3LSYG8	3.0000 % MBGGR 3 07/10/27 EMTN	0	250	0	250 EUR	98.78%	246'960.00	0.03 a)	
DE000A3LSYH6	3.2500 % MBGGR 3 1/4 01/10/32 EMTN	0	150	0	150 EUR	98.52%	147'775.50	0.02 a)	
DE000A3MP4T1	0.0000 % ANNGR 0 12/01/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.42%	186'840.00	0.03 a)	
DE000A3MP4U9	0.2500 % ANNGR 0 1/4 09/01/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	84.43%	337'724.00	0.05 a)	
DE000A3MP4V7	0.7500 % ANNGR 0 3/4 09/01/32 EMTN	400	0	0	400 EUR	74.38%	297'504.00	0.04 a)	
DE000A3MP4W5	1.6250 % ANNGR 1 5/8 09/01/51 EMTN	200	0	0	200 EUR	55.82%	111'648.00	0.02 a)	
DE000A3MQMD2	1.0000 % LEGGR 1 11/19/32	100	0	0	100 EUR	76.22%	76'223.00	0.01 a)	
DE000A3MQNN9	0.3750 % LEGGR 0 3/8 01/17/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.31%	93'306.00	0.01 a)	
DE000A3MQNQ2	1.5000 % LEGGR 1 1/2 01/17/34 EMTN	200	0	0	200 EUR	77.79%	155'582.00	0.02 a)	
DE000A3MQQV5	2.0000 % DBOERS 2 06/23/48	100	100	0	200 EUR	91.23%	182'464.00	0.03 a)	
DE000A3MQS56	1.3750 % ANNGR 1 3/8 01/28/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.29%	285'876.00	0.04 a)	
DE000A3MQS64	1.8750 % ANNGR 1 7/8 06/28/28	200	0	0	200 EUR	91.26%	182'510.00	0.03 a)	
DE000A3MQS72	2.3750 % ANNGR 2 3/8 03/25/32	300	200	300	200 EUR	87.18%	174'360.00	0.02 a)	
DE000AAR0264	0.5000 % AARB 0 1/2 04/07/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	83.08%	166'168.00	0.02 a)	
DE000AAR0298	0.0500 % AARB 0.05 09/02/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.03%	168'054.00	0.02 a)	
DE000AAR0322	0.7500 % AARB 0 3/4 04/18/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.32%	160'636.00	0.02 a)	
DE000BHY0A56	1.2500 % BHH 1 1/4 01/22/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.34%	194'680.00	0.03 a)	
DE000BHY0BP6	1.0000 % BHH 1 02/05/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.67%	187'336.00	0.03 a)	
DE000BHY0GA7	0.5000 % BHH 0 1/2 11/05/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	82.82%	165'642.00	0.02 a)	
DE000BHY0GB5	1.5000 % BHH 1 1/2 04/18/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.68%	181'368.00	0.02 a)	
DE000BHY0GS9	1.1250 % BHH 1 1/8 10/25/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.44%	178'876.00	0.02 a)	
DE000BHY0SL9	0.3750 % BHH 0 3/8 04/21/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	76.59%	76'585.00	0.01 a)	
DE000BLB6JJ0	0.1250 % BYLAN 0 1/8 02/10/28 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BLB6JU7	3.7500 % BYLAN 3 3/4 02/07/29 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000CB0HRQ9	0.7500 % CMZB 0 3/4 03/24/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.37%	192'744.00	0.03 a)	
DE000CB0HRY3	0.1000 % CMZB 0.1 09/11/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.60%	236'500.00	0.03 a)	
DE000CZ40L63	1.1250 % CMZB 1 1/8 05/24/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000CZ40LD5	4.0000 % CMZB 4 03/23/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	99.49%	298'476.00	0.04 a)	
DE000CZ40LW5	4.0000 % CMZB 4 03/30/27 EMTN	260	0	0	260 EUR	99.26%	258'068.20	0.04 a)	
DE000CZ40M39	1.5000 % CMZB 1 1/2 08/28/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.25%	279'741.00	0.04 a)	
DE000CZ40MC5	1.1250 % CMZB 1 1/8 09/19/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.16%	192'328.00	0.03 a)	
DE000CZ40N04	0.6250 % CMZB 0 5/8 08/28/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.39%	295'173.00	0.04 a)	
DE000CZ40N46	1.1250 % CMZB 1 1/8 06/22/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.55%	187'106.00	0.03 a)	
DE000CZ40NS9	1.0000 % CMZB 1 03/04/26 EMTN	350	0	0	350 EUR	94.86%	331'992.50	0.05 a)	
DE000CZ439B6	5.2500 % CMZB 5 1/4 03/25/29	0	200	0	200 EUR	103.13%	206'250.00	0.03 a)	
DE000CZ43Z49	6.7500 % CMZB 6 3/4 10/05/33 EMTN	0	100	0	100 EUR	105.38%	105'375.00	0.01 a)	
DE000CZ43ZB3	4.6250 % CMZB 4 5/8 03/21/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	100.97%	201'944.00	0.03 a)	
DE000CZ43ZN8	5.1250 % CMZB 5 1/8 01/18/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.14%	206'284.00	0.03 a)	
DE000CZ45V82	0.3750 % CMZB 0 3/8 09/01/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.76%	179'524.00	0.02 a)	
DE000CZ45VB7	0.2500 % CMZB 0 1/4 09/16/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.01%	196'016.00	0.03 a)	
DE000CZ45VC5	0.5000 % CMZB 0 1/2 12/04/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.07%	184'146.00	0.03 a)	
DE000CZ45VM4	0.8750 % CMZB 0 7/8 01/22/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.78%	183'564.00	0.03 a)	
DE000CZ45W57	3.0000 % CMZB 3 09/14/27	0	200	0	200 EUR	96.75%	193'502.00	0.03 a)	
DE000CZ45W81	6.5000 % CMZB 6 1/2 12/06/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	103.98%	207'952.00	0.03 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
DE000CZ45WP5	1.3750 % CMZB 1 3/8 12/29/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.63%	89'632.00	0.01	a)
DE000DB7XJP9	1.1250 % DB 1 1/8 03/17/25 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000DFKOL29	0.8750 % DZBK 0 7/8 10/15/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.00%	170'006.00	0.02	a)
DE000DL19T26	1.7500 % DB 1 3/4 01/17/28 EMTN	500	0	0	500 EUR	91.87%	459'335.00	0.06	a)
DE000DL19U23	1.6250 % DB 1 5/8 01/20/27 EMTN	500	0	0	500 EUR	93.27%	466'350.00	0.06	a)
DE000DL19US6	2.6250 % DB 2 5/8 02/12/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.26%	291'768.00	0.04	a)
DE000DL19VB0	5.6250 % DB 5 5/8 05/19/31 EMTN	0	400	0	400 EUR	100.04%	400'148.00	0.05	a)
DE000DL19VD6	1.3750 % DB 1 3/8 06/10/26 EMTN	700	0	0	700 EUR	96.68%	676'725.00	0.09	a)
DE000DL19VP0	1.3750 % DB 1 3/8 09/03/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.70%	191'398.00	0.03	a)
DE000DL19VR6	1.0000 % DB 1 11/19/25 EMTN	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000DL19VS4	1.7500 % DB 1 3/4 11/19/30 EMTN	500	0	0	500 EUR	86.25%	431'245.00	0.06	a)
DE000DL19VT2	0.7500 % DB 0 3/4 02/17/27 EMTN	500	0	0	500 EUR	93.32%	466'615.00	0.06	a)
DE000DL19VU0	1.3750 % DB 1 3/8 02/17/32	400	0	0	400 EUR	81.73%	326'900.00	0.04	a)
DE000DL19WL7	1.8750 % DB 1 7/8 02/23/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.01%	186'016.00	0.03	a)
DE000DL19WN3	4.0000 % DB 4 06/24/32 EMTN	0	400	0	400 EUR	95.14%	380'576.00	0.05	a)
DE000DL19WU8	3.2500 % DB 3 1/4 05/24/28	300	0	0	300 EUR	96.53%	289'575.00	0.04	a)
DE000DW6C003	2.7000 % DZBK 2.7 02/03/25 EMTN	0	99	99	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000DW6C1A2	2.5000 % DZBK 2 1/2 02/03/25 EMTN	0	290	290	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000DW6CZ46	2.1000 % DZBK 2.1 01/10/25 EMTN	0	296	296	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000GRN0024	0.0100 % DKRED 0.01 02/23/26	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000HCB0AZ3	0.3750 % HCOB 0 3/8 03/09/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000HCB0BQ0	6.2500 % HCOB 6 1/4 11/18/24 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000HCB0BS6	4.8750 % HCOB 4 7/8 03/17/25 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000HCB0BZ1	4.8750 % HCOB 4 7/8 03/30/27 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000LB13HZ5	2.2000 % LBBW 2.2 05/09/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.71%	169'422.00	0.02	a)
DE000LB2CHW4	0.3750 % LBBW 0 3/8 05/24/24 806	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000LB2CLH7	0.3750 % LBBW 0 3/8 07/29/26 809	200	0	0	200 EUR	90.68%	181'368.00	0.02	a)
DE000LB2CNE0	0.3750 % LBBW 0 3/8 09/30/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.86%	173'724.00	0.02	a)
DE000LB2CRG6	0.3750 % LBBW 0 3/8 02/18/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.53%	177'066.00	0.02	a)
DE000LB2CW16	0.3750 % LBBW 0 3/8 02/21/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	75.60%	151'204.00	0.02	a)
DE000LB2V5T1	0.3750 % LBBW 0 3/8 05/07/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	82.14%	82'135.00	0.01	a)
DE000LB2V7C3	0.2500 % LBBW 0 1/4 07/21/28 EMTN	200	100	0	300 EUR	83.58%	250'752.00	0.03	a)
DE000LB2V833	0.3750 % LBBW 0 3/8 02/28/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.62%	171'232.00	0.02	a)
DE000MHB64E1	0.3750 % MUNHYP 0 3/8 03/09/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000NLB3UX1	0.0100 % NDB 0.01 09/23/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000NLB4R55	4.8750 % NDB 4 7/8 07/11/28 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000TLX2102	2.5000 % TALANX 2 1/2 07/23/26	200	200	200	200 EUR	98.00%	195'994.00	0.03	a)
DK0009522062	0.6250 % NYKRE 0 5/8 01/17/25 EMTN	150	0	0	150 EUR	97.23%	145'843.50	0.02	a)
DK0009525404	0.1250 % NYKRE 0 1/8 07/10/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.69%	197'376.00	0.03	a)
DK0009526998	0.7500 % NYKRE 0 3/4 01/20/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.47%	182'948.00	0.03	a)
DK0009529901	0.5000 % NYKRE 0 1/2 07/10/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.69%	191'372.00	0.03	a)
DK0030045703	4.0000 % NYKRE 4 07/17/28 EMTN	0	150	0	150 EUR	99.64%	149'457.00	0.02	a)
DK0030467105	0.2500 % NYKRE 0 1/4 01/13/26	300	0	0	300 EUR	93.78%	281'340.00	0.04	a)
DK0030484548	0.3750 % NYKRE 0 3/8 01/17/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	87.14%	217'837.50	0.03	a)
DK0030485271	0.1250 % ENXFP 0 1/8 05/17/26	0	250	0	250 EUR	92.52%	231'305.00	0.03	a)
DK0030486402	0.7500 % ENXFP 0 3/4 05/17/31	0	200	0	200 EUR	82.48%	164'952.00	0.02	a)
DK0030486592	1.5000 % ENXFP 1 1/2 05/17/41	0	100	0	100 EUR	72.61%	72'614.00	0.01	a)
DK0030487996	0.8750 % NYKRE 0 7/8 07/28/31	100	0	0	100 EUR	91.44%	91'444.00	0.01	a)
DK0030506886	1.3750 % NYKRE 1 3/8 07/12/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.44%	92'442.00	0.01	a)
DK0030507694	5.5000 % NYKRE 5 1/2 12/29/32	200	0	0	200 EUR	102.20%	204'390.00	0.03	a)
DK0030512421	4.6250 % NYKRE 4 5/8 01/19/29 EMTN	0	250	0	250 EUR	102.07%	255'185.00	0.04	a)
ES0205032024	1.3750 % FERSM 1 3/8 03/31/25	300	0	0	300 EUR	97.34%	292'013.31	0.04	a)
ES0205032040	0.5400 % FERSM 0.54 11/12/28	100	0	0	100 EUR	87.51%	87'508.00	0.01	a)
ES0205045026	0.8750 % CAIXAB 0 7/8 10/28/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0205046008	4.2500 % AENASM 4 1/4 10/13/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.96%	207'918.00	0.03	a)
ES0205061007	1.6800 % CNGEST 1.68 02/26/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.93%	195'861.80	0.03	a)
ES0211845294	2.5000 % ABESM 2 1/2 02/27/25 CNMV	200	0	0	200 EUR	98.70%	197'392.22	0.03	a)
ES0211845302	1.3750 % ABESM 1 3/8 05/20/26	200	0	0	200 EUR	95.45%	190'893.62	0.03	a)
ES0213307053	0.7500 % CABKSM 0 3/4 07/09/26	200	0	0	200 EUR	93.46%	186'928.86	0.03	a)
ES0213307061	1.1250 % CABKSM 1 1/8 11/12/26	200	0	0	200 EUR	92.97%	185'948.00	0.03	a)
ES0213679HN2	0.8750 % BKTSM 0 7/8 07/08/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.43%	186'854.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
ES0213679JR9	0.6250 % BKTSM 0 5/8 10/06/27	100	0	0	100 EUR	89.97%	89'971.91	0.01	a)
ES0213679OF4	1.2500 % BKTSM 1 1/4 12/23/32	200	0	0	200 EUR	88.79%	177'588.00	0.02	a)
ES0213679OO6	4.3750 % BKTSM 4 3/8 05/03/30	0	200	0	200 EUR	102.17%	204'336.00	0.03	a)
ES0213679OP3	4.8750 % BKTSM 4 7/8 09/13/31	0	200	0	200 EUR	103.87%	207'734.00	0.03	a)
ES0224244071	1.6250 % MAPSM 1 5/8 05/19/26	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0224244089	4.3750 % MAPSM 4 3/8 03/31/47	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0239140025	0.7500 % COLSM 0 3/4 06/22/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.68%	171'364.00	0.02	a)
ES0265936031	5.2500 % ABANCA 5 1/4 09/14/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.54%	207'086.00	0.03	a)
ES0265936056	5.8750 % ABANCA 5 7/8 04/02/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	106.48%	212'952.00	0.03	a)
ES0305045009	1.3750 % CAIXAB 1 3/8 04/10/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0305523005	0.0000 % SIXLTD 0 12/02/25	200	0	0	200 EUR	93.64%	187'288.00	0.03	a)
ES0313307201	0.8750 % CABKSM 0 7/8 03/25/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0313307219	1.0000 % CABKSM 1 06/25/24 EMTN	100	0	0	100 EUR	99.11%	99'113.00	0.01	a)
ES0313679K13	0.8750 % BKTSM 0 7/8 03/05/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0343307023	4.0000 % KUTXAB 4 02/01/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.28%	200'556.00	0.03	a)
ES0343307031	4.7500 % KUTXAB 4 3/4 06/15/27	0	200	0	200 EUR	101.03%	202'064.00	0.03	a)
ES0365936048	5.5000 % ABANCA 5 1/2 05/18/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.41%	202'826.00	0.03	a)
ES0413900939	3.2500 % SANTAN 3 1/4 02/14/28	0	200	0	200 EUR	99.88%	199'768.76	0.03	a)
FR0000471930	8.1250 % ORAFP 8 1/8 01/28/33 EMTN	410	0	0	410 EUR	134.40%	551'048.20	0.08	a)
FR0010033381	6.1250 % VIEFP 6 1/8 11/25/33 EMTN	0	250	0	250 EUR	119.96%	299'905.00	0.04	a)
FR0010891317	4.6250 % EDF 4 5/8 04/26/30 EMTN	0	400	0	400 EUR	104.88%	419'508.00	0.06	a)
FR0010961581	4.5000 % EDF 4 1/2 11/12/40 EMTN	0	250	0	250 EUR	108.52%	271'292.50	0.04	a)
FR0011225143	4.1250 % EDF 4 1/8 03/25/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.39%	304'164.00	0.04	a)
FR0011266527	3.1250 % ADPPF 3 1/8 06/11/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011439785	2.6250 % SAGES 2 5/8 03/06/25	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011509488	2.7500 % ADPPF 2 3/4 06/05/28	300	0	0	300 EUR	97.60%	292'791.00	0.04	a)
FR0011689033	3.2500 % FRFP 3 1/4 01/22/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011689579	3.0000 % BPCEGP 3 07/19/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011832039	2.7500 % KERFP 2 3/4 04/08/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011911247	2.3750 % ENGIFP 2 3/8 05/19/26 EMTN	600	0	0	600 EUR	97.56%	585'384.00	0.08	a)
FR0011949403	4.2500 % CNPFP 4 1/4 06/05/45	200	0	0	200 EUR	99.71%	199'416.00	0.03	a)
FR0011951771	1.8750 % AIFP 1 7/8 06/05/24 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011991488	2.7500 % RTEFRA 2 3/4 06/20/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	96.62%	289'863.00	0.04	a)
FR0012146801	1.7500 % SANFP 1 3/4 09/10/26 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012173862	2.1250 % RIFP 2 1/8 09/27/24	300	0	0	300 EUR	99.03%	297'099.00	0.04	a)
FR0012206993	1.5000 % ADPPF 1 1/2 04/07/25	200	0	0	200 EUR	97.74%	195'478.00	0.03	a)
FR0012222297	4.5000 % ACAFP 4 1/2 PERP	0	200	0	200 EUR	99.77%	199'540.00	0.03	a)
FR0012236669	2.1250 % VPARKI 2 1/8 04/16/25	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012300812	1.8750 % ARRF 1 7/8 01/15/25 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012329845	4.0320 % BNP 4.032 PERP	300	0	0	300 EUR	98.82%	296'469.00	0.04	a)
FR0012370872	2.0000 % NK 2 12/10/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.52%	197'040.00	0.03	a)
FR0012383982	4.1250 % SOGESA 4 1/8 PERP	300	0	0	300 EUR	98.97%	296'913.00	0.04	a)
FR0012384667	1.6250 % PUBFP 1 5/8 12/16/24	300	0	0	300 EUR	98.31%	294'918.00	0.04	a)
FR0012432912	1.1250 % BNFP 1 1/8 01/14/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	97.84%	489'210.00	0.07	a)
FR0012444750	4.2500 % ACAFP 4 1/4 PERP	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012448025	1.5000 % GFCFP 1 1/2 01/20/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.09%	294'282.00	0.04	a)
FR0012452191	1.5000 % AKEFP 1 1/2 01/20/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	98.14%	490'690.00	0.07	a)
FR0012516417	2.5000 % MWDP 2 1/2 02/09/27	0	200	0	200 EUR	97.00%	193'990.00	0.03	a)
FR0012599892	1.3750 % EDENFP 1 3/8 03/10/25	200	0	0	200 EUR	97.46%	194'928.00	0.03	a)
FR0012601367	0.8750 % SUFP 0 7/8 03/11/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.20%	194'390.00	0.03	a)
FR0012602761	1.0000 % ENGIFP 1 03/13/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.07%	285'210.00	0.04	a)
FR0012766889	1.2500 % AIFP 1 1/4 06/03/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.20%	194'404.00	0.03	a)
FR0012881555	2.2000 % TERECA 2.2 08/05/25	200	0	0	200 EUR	97.46%	194'928.00	0.03	a)
FR0012949923	1.7500 % VIEFP 1 3/4 09/10/25 EMTN	0	300	0	300 EUR	97.04%	291'120.00	0.04	a)
FR0012969038	1.5000 % SANFP 1 1/2 09/22/25 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012969129	1.5000 % SAGES 1 1/2 10/25/27	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013053329	1.8750 % SANEFP 1 7/8 03/16/26	300	0	0	300 EUR	96.40%	289'206.00	0.04	a)
FR0013060209	1.6250 % RTEFRA 1 5/8 11/27/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.00%	96'997.00	0.01	a)
FR0013063609	1.2500 % BNFP 1 1/4 05/30/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013066388	4.5000 % CNPFP 4 1/2 06/10/47	200	0	0	200 EUR	100.54%	201'080.00	0.03	a)
FR0013067196	3.0000 % SCOR 3 06/08/46	0	200	0	200 EUR	97.03%	194'062.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR0013076353	2.8000 % ACAFP 2.8 01/27/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.08%	194'158.00	0.03	a)
FR0013121753	1.8750 % LIFP 1 7/8 02/19/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.43%	192'850.00	0.03	a)
FR0013134897	2.8500 % ACAFP 2.85 04/27/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	96.96%	290'877.00	0.04	a)
FR0013139482	1.6250 % FRFP 1 5/8 03/18/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.99%	191'984.00	0.03	a)
FR0013143997	0.6250 % SANFP 0 5/8 04/05/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013144003	1.1250 % SANFP 1 1/8 04/05/28 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013152899	1.0000 % RTEFRA 1 10/19/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	94.05%	188'098.00	0.03	a)
FR0013152907	2.0000 % RTEFRA 2 04/18/36 EMTN	0	100	0	100 EUR	84.53%	84'527.00	0.01	a)
FR0013155009	2.8750 % BPCEGP 2 7/8 04/22/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013165677	1.2500 % KERFP 1 1/4 05/10/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.25%	190'508.00	0.03	a)
FR0013169885	1.0000 % DGFP 1 05/13/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.80%	189'596.00	0.03	a)
FR0013170834	1.8750 % COVFP 1 7/8 05/20/26	100	0	0	100 EUR	95.58%	95'583.00	0.01	a)
FR0013172939	1.5000 % RIFP 1 1/2 05/18/26	200	0	0	200 EUR	95.93%	191'866.00	0.03	a)
FR0013173028	3.2500 % CMARK 3 1/4 06/01/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.78%	197'558.00	0.03	a)
FR0013173432	1.2500 % VIEFP 1 1/4 05/19/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	91.25%	364'992.00	0.05	a)
FR0013176310	1.8750 % VIVFP 1 7/8 05/26/26	200	0	0	200 EUR	98.23%	196'462.00	0.03	a)
FR0013181898	3.0000 % FRLBP 3 06/09/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.84%	96'842.00	0.01	a)
FR0013181906	1.7500 % ICADFP 1 3/4 06/10/26	300	0	0	300 EUR	94.99%	284'970.00	0.04	a)
FR0013182078	1.1250 % ARFP 1 1/8 01/09/26 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013182847	1.2500 % AIFP 1 1/4 06/13/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.21%	276'630.00	0.04	a)
FR0013201126	0.3750 % DGFP 0 3/8 02/07/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.85%	290'553.00	0.04	a)
FR0013201134	0.7500 % DGFP 0 3/4 09/09/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.47%	178'930.00	0.02	a)
FR0013201308	0.2500 % SUFP 0 1/4 09/09/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.18%	294'543.00	0.04	a)
FR0013201639	0.5000 % SANFP 0 1/2 01/13/27 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013203734	4.7500 % ACAFP 4 3/4 09/27/48	0	400	0	400 EUR	100.79%	403'144.00	0.06	a)
FR0013203825	1.2500 % LIFP 1 1/4 09/29/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	82.55%	247'647.00	0.03	a)
FR0013204468	1.0000 % BPCEGP 1 10/05/28 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013205069	1.0000 % GFCFP 1 01/30/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.47%	176'934.00	0.02	a)
FR0013213295	1.0000 % EDF 1 10/13/26 EMTN	0	400	0	400 EUR	93.76%	375'052.00	0.05	a)
FR0013214137	0.6250 % SAGESS 0 5/8 10/20/28	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013216918	0.7090 % BNFP 0.709 11/03/24 EMTN	100	0	0	100 EUR	98.00%	97'998.00	0.01	a)
FR0013216926	1.2080 % BNFP 1.208 11/03/28 EMTN	500	0	0	500 EUR	91.18%	455'875.00	0.06	a)
FR0013217114	0.8750 % ORAFP 0 7/8 02/03/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.05%	279'156.00	0.04	a)
FR0013218393	1.1250 % ICADFP 1 1/8 11/17/25	200	0	0	200 EUR	95.04%	190'074.00	0.03	a)
FR0013220266	1.8750 % ARFP 1 7/8 01/06/31 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013222494	1.3750 % ENFP 1 3/8 06/07/27	300	0	0	300 EUR	93.74%	281'223.00	0.04	a)
FR0013231099	1.2500 % DGFP 1 1/4 01/18/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.45%	283'353.00	0.04	a)
FR0013231768	1.5000 % NK 1 1/2 01/15/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.73%	93'731.00	0.01	a)
FR0013236544	3.5000 % CMARK 3 1/2 02/09/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.74%	193'488.00	0.03	a)
FR0013238045	1.3750 % LIFP 1 3/8 02/16/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.56%	187'128.00	0.03	a)
FR0013241346	1.0000 % AIFP 1 03/08/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.54%	187'074.00	0.03	a)
FR0013241361	1.3750 % RENAUL 1 3/8 03/08/24 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013241676	1.5000 % ORAFP 1 1/2 09/09/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.78%	187'568.00	0.03	a)
FR0013245586	2.0000 % STLA 2 03/23/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013245867	1.5000 % ENGIFP 1 1/2 03/27/28 EMTN	500	0	0	500 EUR	92.13%	460'645.00	0.06	a)
FR0013247202	1.8750 % EDENFP 1 7/8 03/30/27	300	0	0	300 EUR	94.51%	283'536.00	0.04	a)
FR0013248507	1.0000 % VIEFP 1 04/03/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.96%	290'877.00	0.04	a)
FR0013248523	1.5000 % VIEFP 1 1/2 04/03/29 EMTN	400	0	0	400 EUR	90.77%	363'072.00	0.05	a)
FR0013250693	1.6250 % RENAUL 1 5/8 04/11/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.49%	194'974.00	0.03	a)
FR0013251170	1.1250 % DGFP 1 1/8 04/20/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.30%	285'894.00	0.04	a)
FR0013257623	0.7500 % MCFP 0 3/4 05/26/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013258936	1.2500 % CMARK 1 1/4 05/31/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013260551	1.6250 % ARFP 1 5/8 01/13/32 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013262698	1.5000 % COVFP 1 1/2 06/21/27	200	0	0	200 EUR	92.51%	185'028.00	0.03	a)
FR0013264421	1.5000 % CTEFRA 1 1/2 07/29/28	0	300	0	300 EUR	91.34%	274'005.00	0.04	a)
FR0013266368	2.0000 % GFCFP 2 06/30/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.09%	178'188.00	0.02	a)
FR0013266830	0.7500 % LRFP 0 3/4 07/06/24	100	0	0	100 EUR	98.92%	98'922.00	0.01	a)
FR0013266848	1.8750 % LRFP 1 7/8 07/06/32	200	0	0	200 EUR	90.38%	180'762.00	0.02	a)
FR0013282571	0.8750 % VIVFP 0 7/8 09/18/24 EMTN	100	0	0	100 EUR	98.53%	98'532.00	0.01	a)
FR0013283140	1.6250 % VIEFP 1 5/8 09/21/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.89%	169'786.00	0.02	a)
FR0013284205	1.3750 % GFCFP 1 3/8 01/26/28 EMTN	200	100	0	300 EUR	92.11%	276'318.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR0013284254	1.3750 % ENGIFP 1 3/8 02/28/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	90.15%	270'456.00	0.04	a)
FR0013284270	2.0000 % ENGIFP 2 09/28/37 EMTN	500	0	0	500 EUR	79.44%	397'180.00	0.05	a)
FR0013286788	1.1250 % DGFP 1 1/8 10/13/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.70%	185'394.00	0.03	a)
FR0013286838	1.0000 % FRLBP 1 10/16/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.27%	196'540.00	0.03	a)
FR0013290749	1.8750 % RTEFRA 1 7/8 10/23/37 EMTN	0	300	0	300 EUR	81.49%	244'467.00	0.03	a)
FR0013291556	1.8750 % CMARK 1 7/8 10/25/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013295722	1.5000 % ARRF 1 1/2 01/17/33 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013298676	1.6250 % HITTFP 1 5/8 11/27/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.78%	185'560.00	0.03	a)
FR0013299468	1.3500 % CRLOG 1.35 11/28/29	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013299641	1.0000 % BNP 1 11/29/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.64%	195'270.00	0.03	a)
FR0013300605	1.6250 % LIFP 1 5/8 12/13/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	83.17%	166'332.00	0.02	a)
FR0013302197	1.0000 % ADPFP 1 12/13/27	0	100	0	100 EUR	91.62%	91'623.00	0.01	a)
FR0013302809	0.8750 % SUFP 0 7/8 12/13/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.90%	187'804.00	0.03	a)
FR0013310224	1.3750 % ORAFP 1 3/8 01/16/30 EMTN	500	0	0	500 EUR	89.35%	446'750.00	0.06	a)
FR0013310455	1.3750 % DGFP 1 3/8 01/22/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.47%	178'936.00	0.02	a)
FR0013311503	1.1250 % SOCGEN 1 1/8 01/23/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	97.65%	390'608.00	0.05	a)
FR0013312154	2.6250 % ACAFP 2 5/8 01/29/48	0	400	0	400 EUR	92.87%	371'484.00	0.05	a)
FR0013312501	1.6250 % BPCEGP 1 5/8 01/31/28 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013320058	1.6250 % ICADFP 1 5/8 02/28/28	200	0	0	200 EUR	90.94%	181'870.00	0.02	a)
FR0013322989	1.6250 % GFCFP 1 5/8 03/14/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.42%	178'848.00	0.02	a)
FR0013323326	2.0000 % STLA 2 03/20/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.98%	293'943.00	0.04	a)
FR0013323664	1.3750 % BPCEGP 1 3/8 03/23/26 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013323870	1.3750 % ORAFP 1 3/8 03/20/28 EMTN	500	0	0	500 EUR	92.56%	462'775.00	0.06	a)
FR0013324340	1.0000 % SANFP 1 03/21/26 8FXD	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013324357	1.3750 % SANFP 1 3/8 03/21/30 12FX	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013324373	1.8750 % SANFP 1 7/8 03/21/38 20FX	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013327962	1.0000 % CAPFP 1 10/18/24	100	0	0	100 EUR	98.23%	98'226.00	0.01	a)
FR0013327988	1.7500 % CAPFP 1 3/4 04/18/28	200	0	0	200 EUR	93.36%	186'712.00	0.03	a)
FR0013330099	1.6250 % VPARKI 1 5/8 04/19/28	200	0	0	200 EUR	91.94%	183'880.00	0.03	a)
FR0013330537	2.8750 % URWFP 2 7/8 PERP	200	0	0	200 EUR	93.25%	186'500.00	0.03	a)
FR0013332988	1.1250 % URWFP 1 1/8 09/15/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.89%	287'667.00	0.04	a)
FR0013332996	1.8750 % URWFP 1 7/8 01/15/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	86.84%	260'514.00	0.04	a)
FR0013333002	2.2500 % URWFP 2 1/4 05/14/38 EMTN	300	0	0	300 EUR	81.17%	243'507.00	0.03	a)
FR0013334695	1.6250 % RENAUL 1 5/8 05/26/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.05%	285'147.00	0.04	a)
FR0013335767	1.5000 % FLYFP 1 1/2 05/29/25	0	200	0	200 EUR	97.04%	194'086.00	0.03	a)
FR0013342334	1.5000 % FRFP 1 1/2 06/18/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.83%	290'493.00	0.04	a)
FR0013344215	1.3750 % SUFP 1 3/8 06/21/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.86%	281'568.00	0.04	a)
FR0013346137	1.3750 % DGFP 1 3/8 06/27/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.52%	277'554.00	0.04	a)
FR0013346822	1.8750 % RCFFP 1 7/8 07/02/25	200	0	0	200 EUR	96.17%	192'344.00	0.03	a)
FR0013349099	2.0000 % FRLBP 2 07/13/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	92.85%	371'400.00	0.05	a)
FR0013357845	0.8750 % MLFP 0 7/8 09/03/25 EUR	200	0	0	200 EUR	96.16%	192'328.00	0.03	a)
FR0013357852	1.7500 % MLFP 1 3/4 09/03/30 EUR	300	0	0	300 EUR	91.18%	273'528.00	0.04	a)
FR0013357860	2.5000 % MLFP 2 1/2 09/03/38	300	0	0	300 EUR	92.35%	277'047.00	0.04	a)
FR0013358124	1.3750 % HSBC 1 3/8 09/04/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	90.95%	272'847.00	0.04	a)
FR0013359197	1.0000 % ORAFP 1 09/12/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.22%	192'434.00	0.03	a)
FR0013359239	1.8750 % ORAFP 1 7/8 09/12/30 EMTN	500	0	0	500 EUR	90.98%	454'900.00	0.06	a)
FR0013359254	1.6250 % VIEFP 1 5/8 09/17/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.36%	176'720.00	0.02	a)
FR0013365293	1.8750 % ENGIFP 1 7/8 09/19/33 EMTN	400	0	0	400 EUR	84.09%	336'368.00	0.05	a)
FR0013367620	1.0000 % DGFP 1 09/26/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.03%	96'030.00	0.01	a)
FR0013367638	1.7500 % DGFP 1 3/4 09/26/30 EMTN	400	0	0	400 EUR	90.01%	360'028.00	0.05	a)
FR0013368164	1.5000 % RTEFRA 1 1/2 09/27/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	88.41%	88'411.00	0.01	a)
FR0013368172	2.1250 % RTEFRA 2 1/8 09/27/38 EMTN	0	100	0	100 EUR	83.18%	83'182.00	0.01	a)
FR0013368545	2.0000 % EDF 2 10/02/30 EMTN	0	300	0	300 EUR	89.99%	269'961.00	0.04	a)
FR0013368602	2.1250 % SOCGEN 2 1/8 09/27/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.69%	281'055.00	0.04	a)
FR0013369493	2.0000 % ETLFP 2 10/02/25	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013371549	2.1250 % ADPFP 2 1/8 10/11/38 EUR	200	0	0	200 EUR	84.22%	168'444.00	0.02	a)
FR0013381704	2.3750 % BNP 2 3/8 11/20/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.80%	193'604.00	0.03	a)
FR0013382348	1.5000 % ARRF 1 1/2 01/25/30 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013383213	1.7500 % CAFP 1 3/4 05/04/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.56%	193'116.00	0.03	a)
FR0013385473	1.9400 % VIEFP 1.94 01/07/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	91.21%	91'210.00	0.01	a)
FR0013393774	2.0000 % RENAUL 2 07/11/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	99.33%	198'656.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR0013396447	1.0000 % BPCEGP 1 07/15/24	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013396512	1.1250 % ORAFP 1 1/8 07/15/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.99%	197'988.00	0.03 a)	
FR0013396520	2.0000 % ORAFP 2 01/15/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.99%	93'993.00	0.01 a)	
FR0013396876	1.5000 % SUFP 1 1/2 01/15/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.54%	93'539.00	0.01 a)	
FR0013397320	1.3750 % CMARK 1 3/8 01/17/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.89%	195'786.00	0.03 a)	
FR0013397452	1.6250 % DGFP 1 5/8 01/18/29 EMTN	400	0	0	400 EUR	92.28%	369'100.00	0.05 a)	
FR0013398070	2.1250 % BNP 2 1/8 01/23/27 EMTN	700	0	0	700 EUR	96.76%	677'327.00	0.09 a)	
FR0013398229	3.2500 % ENGIFP 3 1/4 PERP	300	0	0	300 EUR	98.50%	295'500.00	0.04 a)	
FR0013399680	2.7500 % CNPFP 2 3/4 02/05/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.19%	190'386.00	0.03 a)	
FR0013403441	1.2500 % SOCGEN 1 1/4 02/15/24 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013404571	1.3750 % DGFP 1 3/8 02/21/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.24%	174'472.00	0.02 a)	
FR0013405032	1.0000 % URWFP 1 02/27/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.28%	276'852.00	0.04 a)	
FR0013405040	1.7500 % URWFP 1 3/4 02/27/34 EMTN	300	0	0	300 EUR	83.14%	249'432.00	0.03 a)	
FR0013405537	1.1250 % BNP 1 1/8 08/28/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013407418	3.3750 % CMARK 3 3/8 03/11/31	200	0	0	200 EUR	93.40%	186'806.00	0.03 a)	
FR0013408960	1.7500 % BFCM 1 3/4 03/15/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	90.29%	270'867.00	0.04 a)	
FR0013409844	0.8750 % SANFP 0 7/8 03/21/29 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013410818	1.7500 % SOCGEN 1 3/4 03/22/29 EMTN	400	0	0	400 EUR	90.24%	360'952.00	0.05 a)	
FR0013412343	1.0000 % BPCEGP 1 04/01/25 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013412707	1.7500 % RENAUL 1 3/4 04/10/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.63%	191'252.00	0.03 a)	
FR0013412947	0.7500 % BFCM 0 3/4 06/08/26 EMTN	500	0	0	500 EUR	93.70%	468'490.00	0.06 a)	
FR0013413887	2.3750 % ORAFP 2 3/8 PERP EMTN	500	0	0	500 EUR	97.38%	486'875.00	0.07 a)	
FR0013414091	1.6250 % CMARK 1 5/8 04/15/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	95.74%	95'738.00	0.01 a)	
FR0013414158	1.0000 % IDFMOB 1 05/25/34 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.72%	161'448.00	0.02 a)	
FR0013414919	3.3750 % ORANOF 3 3/8 04/23/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.49%	196'980.00	0.03 a)	
FR0013415692	1.3750 % FRLBP 1 3/8 04/24/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.05%	178'106.00	0.02 a)	
FR0013416146	2.3750 % ELOFR 2 3/8 04/25/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.69%	293'061.00	0.04 a)	
FR0013419736	1.0000 % CAFP 1 05/17/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.48%	184'958.00	0.03 a)	
FR0013421369	1.1250 % CMARK 1 1/8 05/23/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	88.35%	88'354.00	0.01 a)	
FR0013421815	1.0000 % ACAFP 1 07/03/29 EMTN	0	500	0	500 EUR	87.59%	437'925.00	0.06 a)	
FR0013422011	1.3750 % BNP 1 3/8 05/28/29 EMTN	400	0	0	400 EUR	88.59%	354'360.00	0.05 a)	
FR0013422227	1.6250 % GFCFP 1 5/8 05/29/34 EMTN	200	0	0	200 EUR	83.21%	166'414.00	0.02 a)	
FR0013424868	0.6250 % VIVFP 0 5/8 06/11/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.43%	194'860.00	0.03 a)	
FR0013424876	1.1250 % VIVFP 1 1/8 12/11/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.50%	192'992.00	0.03 a)	
FR0013425139	0.6250 % PUBFP 0 5/8 06/13/25	200	0	0	200 EUR	95.89%	191'776.00	0.03 a)	
FR0013425147	1.2500 % PUBFP 1 1/4 06/13/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.33%	182'656.00	0.03 a)	
FR0013425154	1.7500 % PUBFP 1 3/4 06/13/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.39%	176'780.00	0.02 a)	
FR0013425162	1.8750 % BFCM 1 7/8 06/18/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.71%	179'416.00	0.02 a)	
FR0013426368	1.1250 % ADPPF 1 1/8 06/18/34	200	0	0	200 EUR	78.80%	157'602.00	0.02 a)	
FR0013428489	0.3750 % ENGIFP 0 3/8 06/21/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.97%	269'919.00	0.04 a)	
FR0013428513	1.3750 % ENGIFP 1 3/8 06/21/39 EMTN	200	0	0	200 EUR	69.26%	138'528.00	0.02 a)	
FR0013429073	0.6250 % BPCEGP 0 5/8 09/26/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013430535	1.1250 % INLIFP 1 1/8 07/02/29	200	0	0	200 EUR	87.00%	174'000.00	0.02 a)	
FR0013430733	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 07/01/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.30%	186'598.00	0.03 a)	
FR0013430741	0.6250 % LIFP 0 5/8 07/01/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	82.04%	246'105.00	0.03 a)	
FR0013431277	1.6250 % BNP 1 5/8 07/02/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	83.74%	251'226.00	0.03 a)	
FR0013431715	1.7500 % URWFP 1 3/4 07/01/49 EMTN	200	0	0	200 EUR	61.95%	123'906.00	0.02 a)	
FR0013432770	0.1250 % BFCM 0 1/8 02/05/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013433596	0.2500 % FRLBP 0 1/4 07/12/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.46%	92'459.00	0.01 a)	
FR0013434776	0.5000 % BNP 0 1/2 07/15/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.74%	197'474.00	0.03 a)	
FR0013444304	0.1000 % HSBC 0.1 09/03/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.89%	266'676.00	0.04 a)	
FR0013444536	0.0000 % DSYFP 0 09/16/24	200	0	0	200 EUR	97.98%	195'956.00	0.03 a)	
FR0013444544	0.1250 % DSYFP 0 1/8 09/16/26	400	0	0	400 EUR	92.23%	368'912.00	0.05 a)	
FR0013444551	0.3750 % DSYFP 0 3/8 09/16/29	300	0	0	300 EUR	86.02%	258'063.00	0.04 a)	
FR0013444676	0.0000 % ORAFP 0 09/04/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.72%	183'430.00	0.03 a)	
FR0013444684	0.5000 % ORAFP 0 1/2 09/04/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.30%	156'598.00	0.02 a)	
FR0013444692	1.3750 % ORAFP 1 3/8 09/04/49 EMTN	200	0	0	200 EUR	67.61%	135'218.00	0.02 a)	
FR0013444759	0.1250 % BNP 0 1/8 09/04/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	91.78%	275'340.00	0.04 a)	
FR0013445152	1.1250 % RTEFRA 1 1/8 09/09/49 EMTN	0	300	0	300 EUR	61.67%	185'013.00	0.03 a)	
FR0013445335	1.6250 % VIEFP 1 5/8 PERP	400	0	0	400 EUR	92.29%	369'152.00	0.05 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR0013447166	1.1250 % STLA 1 1/8 09/18/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	87.97%	263'916.00	0.04	a)
FR0013447877	1.7500 % ORAFP 1 3/4 PERP EMTN	700	0	0	700 EUR	92.38%	646'625.00	0.09	a)
FR0013448032	0.2500 % WLNFP 0 1/4 09/18/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013448859	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 09/24/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.85%	169'696.00	0.02	a)
FR0013449998	1.6250 % ELISGP 1 5/8 04/03/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	91.63%	91'633.00	0.01	a)
FR0013450822	0.3750 % CMARK 0 3/8 10/03/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.42%	86'422.00	0.01	a)
FR0013452620	0.5000 % VIEFP 0 1/2 10/14/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	79.79%	239'361.00	0.03	a)
FR0013452893	2.2500 % TKOFP 2 1/4 10/14/26	0	200	0	200 EUR	95.52%	191'034.00	0.03	a)
FR0013453040	0.2500 % ALOFP 0 1/4 10/14/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.10%	182'196.00	0.03	a)
FR0013455540	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 02/24/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013455813	0.5000 % ENGIFP 0 1/2 10/24/30 EMTN	500	0	0	500 EUR	81.15%	405'730.00	0.06	a)
FR0013455821	1.2500 % ENGIFP 1 1/4 10/24/41	300	0	0	300 EUR	63.69%	191'076.00	0.03	a)
FR0013456449	0.8750 % RIFP 0 7/8 10/24/31	200	0	0	200 EUR	82.91%	165'812.00	0.02	a)
FR0013456621	0.8750 % URWFP 0 7/8 03/29/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	78.35%	156'700.00	0.02	a)
FR0013457058	0.5000 % ALSFR 0 1/2 10/30/34 EMTN	300	0	0	300 EUR	74.60%	223'809.00	0.03	a)
FR0013457967	0.8750 % PRAEFP 0 7/8 11/04/29	0	100	0	100 EUR	81.93%	81'929.00	0.01	a)
FR0013463650	0.1250 % EFPF 0 1/8 05/27/25 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013463668	0.3750 % EFPF 0 3/8 11/27/27 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013463676	0.7500 % EFPF 0 3/4 11/27/31	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013463775	2.0000 % CNPFP 2 07/27/50	200	0	0	200 EUR	85.87%	171'742.00	0.02	a)
FR0013465358	0.5000 % BNP 0 1/2 06/04/26	200	0	0	200 EUR	95.78%	191'550.00	0.03	a)
FR0013465424	2.0000 % EDF 2 12/09/49 EMTN	0	500	0	500 EUR	64.46%	322'275.00	0.04	a)
FR0013476090	1.1250 % RENAUL 1 1/8 01/15/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.68%	185'364.00	0.03	a)
FR0013476199	0.2500 % BPCEGP 0 1/4 01/15/26	600	400	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013476207	0.6250 % BPCEGP 0 5/8 01/15/30	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013476553	0.7500 % BFCM 0 3/4 01/17/30	300	0	0	300 EUR	83.32%	249'957.00	0.03	a)
FR0013476595	0.6640 % VIEFP 0.664 01/15/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	82.36%	247'086.00	0.03	a)
FR0013476611	1.1250 % BNP 1 1/8 01/15/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.52%	181'034.00	0.02	a)
FR0013479276	0.7500 % SOCGEN 0 3/4 01/25/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	91.47%	365'892.00	0.05	a)
FR0013482817	0.0000 % MCFP 0 02/11/24 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013482825	0.0000 % MCFP 0 02/11/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	93.87%	375'484.00	0.05	a)
FR0013482833	0.1250 % MCFP 0 1/8 02/11/28	600	0	0	600 EUR	89.11%	534'636.00	0.07	a)
FR0013482841	0.3750 % MCFP 0 3/8 02/11/31	300	100	0	400 EUR	83.25%	332'996.00	0.05	a)
FR0013484458	0.5000 % BNP 0 1/2 02/19/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	90.59%	362'368.00	0.05	a)
FR0013486701	0.1250 % SOCGEN 0 1/8 02/24/26	300	0	0	300 EUR	93.48%	280'428.00	0.04	a)
FR0013494168	0.2500 % SUFP 0 1/4 03/11/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	86.43%	259'275.00	0.04	a)
FR0013495181	0.5710 % BNFP 0.571 03/17/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.64%	92'642.00	0.01	a)
FR0013504677	1.7500 % ENGIFP 1 3/4 03/27/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.01%	279'024.00	0.04	a)
FR0013505104	1.0000 % SANFP 1 04/01/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013505112	1.5000 % SANFP 1 1/2 04/01/30 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013505260	2.6250 % CAFP 2 5/8 12/15/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.79%	290'379.00	0.04	a)
FR0013505542	1.2500 % VIEFP 1 1/4 04/02/27 EMTN	600	0	0	600 EUR	93.54%	561'240.00	0.08	a)
FR0013505625	2.1250 % ADPFP 2 1/8 10/02/26	200	0	0	200 EUR	96.66%	193'326.00	0.03	a)
FR0013505633	2.7500 % ADPFP 2 3/4 04/02/30	500	0	0	500 EUR	96.10%	480'485.00	0.07	a)
FR0013506292	1.2500 % ORAFP 1 1/4 07/07/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	93.34%	93'339.00	0.01	a)
FR0013506300	1.6250 % ORAFP 1 5/8 04/07/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	87.27%	261'795.00	0.04	a)
FR0013506508	0.7500 % MCFP 0 3/4 04/07/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	96.95%	387'800.00	0.05	a)
FR0013506524	1.1250 % RIFP 1 1/8 04/07/25	300	0	0	300 EUR	97.20%	291'585.00	0.04	a)
FR0013506532	1.7500 % RIFP 1 3/4 04/08/30	300	0	0	300 EUR	90.95%	272'835.00	0.04	a)
FR0013506821	2.6250 % URWFP 2 5/8 04/09/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.76%	191'526.00	0.03	a)
FR0013506862	1.0000 % SUFP 1 04/09/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.27%	186'540.00	0.03	a)
FR0013507654	1.1250 % ENFP 1 1/8 07/24/28	300	0	0	300 EUR	91.18%	273'528.00	0.04	a)
FR0013507852	1.6250 % CAPFP 1 5/8 04/15/26	200	0	0	200 EUR	96.02%	192'044.00	0.03	a)
FR0013507860	2.0000 % CAPFP 2 04/15/29	200	100	0	300 EUR	93.32%	279'960.00	0.04	a)
FR0013507878	2.3750 % CAPFP 2 3/8 04/15/32	400	0	0	400 EUR	91.79%	367'156.00	0.05	a)
FR0013508512	1.0000 % ACAFP 1 04/22/26 EMTN	0	500	0	500 EUR	96.60%	483'010.00	0.07	a)
FR0013508710	1.1250 % BNP 1 1/8 04/17/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.54%	268'611.00	0.04	a)
FR0013509098	1.1250 % SOCGEN 1 1/8 04/21/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.74%	193'484.00	0.03	a)
FR0013509627	2.0000 % DECFP 2 10/24/24	200	0	0	200 EUR	98.77%	197'534.00	0.03	a)
FR0013509643	2.6250 % DECFP 2 5/8 04/24/28	200	0	0	200 EUR	95.91%	191'814.00	0.03	a)
FR0013509726	0.6250 % BPCEGP 0 5/8 04/28/25	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR0013510179	2.8750 % ELOFR 2 7/8 01/29/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.76%	96'760.00	0.01	a)
FR0013511227	0.8750 % CMARK 0 7/8 05/07/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.63%	183'256.00	0.03	a)
FR0013512407	0.7500 % KERFP 0 3/4 05/13/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.03%	180'060.00	0.02	a)
FR0013512449	1.2500 % VIEFP 1 1/4 05/14/35 EMTN	300	0	0	300 EUR	79.16%	237'465.00	0.03	a)
FR0013512621	1.0000 % DGFP 1 05/19/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	84.60%	253'785.00	0.03	a)
FR0013512944	2.7500 % STLA 2 3/4 05/15/26	500	0	0	500 EUR	98.12%	490'590.00	0.07	a)
FR0013513538	0.7500 % LRFP 0 3/4 05/20/30	200	0	0	200 EUR	86.31%	172'624.00	0.02	a)
FR0013515749	1.2500 % BFCM 1 1/4 06/03/30	300	0	0	300 EUR	85.05%	255'159.00	0.04	a)
FR0013516069	0.3750 % EFFF 0 3/8 01/05/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013516077	0.5000 % EFFF 0 1/2 06/05/28 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013516184	1.6250 % ACAFP 1 5/8 06/05/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	96.38%	192'758.00	0.03	a)
FR0013517026	0.3950 % BNFP 0.395 06/10/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.05%	172'108.00	0.02	a)
FR0013517190	0.3750 % ENGIFP 0 3/8 06/11/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.08%	180'164.00	0.02	a)
FR0013517307	1.2500 % CMARK 1 1/4 06/11/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.39%	178'782.00	0.02	a)
FR0013518024	0.5000 % FRLBP 0 1/2 06/17/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.68%	191'368.00	0.03	a)
FR0013518057	1.2500 % SOCGEN 1 1/4 06/12/30	400	0	0	400 EUR	85.17%	340'684.00	0.05	a)
FR0013518537	1.3750 % EDENFP 1 3/8 06/18/29	0	200	0	200 EUR	89.09%	178'186.00	0.02	a)
FR0013519071	1.1250 % CAPFP 1 1/8 06/23/30	300	0	0	300 EUR	86.87%	260'616.00	0.04	a)
FR0013519261	2.1250 % LAMON 2 1/8 06/23/31	200	0	0	200 EUR	86.08%	172'154.00	0.02	a)
FR0013519279	1.6250 % COVFP 1 5/8 06/23/30	200	0	0	200 EUR	87.00%	173'990.00	0.02	a)
FR0013521267	2.0000 % URWFP 2 06/29/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.02%	172'036.00	0.02	a)
FR0013521564	0.8750 % WLNFP 0 7/8 06/30/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.39%	178'788.00	0.02	a)
FR0013521630	2.5000 % CNPFP 2 1/2 06/30/51 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.11%	172'226.00	0.02	a)
FR0013522141	1.5000 % ADPFP 1 1/2 07/02/32	300	0	0	300 EUR	85.74%	257'211.00	0.04	a)
FR0013522695	0.6250 % RTEFRA 0 5/8 07/08/32 EMTN	0	100	0	100 EUR	79.16%	79'157.00	0.01	a)
FR0013522703	1.1250 % RTEFRA 1 1/8 07/08/40 EMTN	0	200	0	200 EUR	69.00%	138'002.00	0.02	a)
FR0013523602	2.0000 % ACAFP 2 07/17/30	0	300	0	300 EUR	86.68%	260'052.00	0.04	a)
FR0013524865	3.2500 % ELOFR 3 1/4 07/23/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.68%	287'040.00	0.04	a)
FR0013532280	0.5000 % BNP 0 1/2 09/01/28	200	0	0	200 EUR	88.86%	177'716.00	0.02	a)
FR0013533031	2.7500 % ORANOF 2 3/4 03/08/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.52%	191'046.00	0.03	a)
FR0013534278	0.1250 % ARRF 0 1/8 01/18/29 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013534484	0.1250 % ORAFP 0 1/8 09/16/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.14%	168'286.00	0.02	a)
FR0013534500	0.8750 % TERECA 0 7/8 09/17/30	0	100	0	100 EUR	82.60%	82'595.00	0.01	a)
FR0013534674	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 09/15/27 DMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013535150	1.3750 % PRAEFP 1 3/8 09/17/30	300	0	0	300 EUR	82.75%	248'259.00	0.03	a)
FR0013536661	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 09/22/28	300	0	0	300 EUR	89.94%	269'811.00	0.04	a)
FR00140003P3	0.1000 % BFCM 0.1 10/08/27 EMTN	100	100	0	200 EUR	88.86%	177'724.00	0.02	a)
FR00140005C6	1.5000 % ETLFP 1 1/2 10/13/28	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR00140005J1	0.3750 % BNP 0 3/8 10/14/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.47%	182'942.00	0.03	a)
FR00140005L7	1.7500 % ORAFP 1 3/4 PERP EMTN	200	0	0	200 EUR	88.38%	176'750.00	0.02	a)
FR0014000774	0.7500 % LAMON 0 3/4 04/20/26	200	0	0	200 EUR	93.25%	186'502.00	0.03	a)
FR00140007J7	0.6250 % BFCM 0 5/8 02/21/31 EMTN	400	0	0	400 EUR	80.37%	321'496.00	0.04	a)
FR0014000D31	0.0000 % MLFP 0 11/02/28	100	100	0	200 EUR	86.31%	172'626.00	0.02	a)
FR0014000D49	0.2500 % MLFP 0 1/4 11/02/32	200	0	0	200 EUR	77.80%	155'608.00	0.02	a)
FR0014000KN6	0.2000 % IDFMOB 0.2 11/16/35 EMTN	200	0	0	200 EUR	69.89%	139'774.00	0.02	a)
FR0014000KT3	0.8750 % LIFP 0 7/8 02/17/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.92%	81'918.00	0.01	a)
FR0014000OZ2	1.0000 % SOCGEN 1 11/24/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.04%	282'129.00	0.04	a)
FR0014000PF1	0.0000 % DGFP 0 11/27/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	85.97%	171'938.00	0.02	a)
FR0014000UC8	0.6250 % URWFP 0 5/8 05/04/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.74%	181'472.00	0.02	a)
FR0014000UD6	1.3750 % URWFP 1 3/8 12/04/31 EMTN	400	0	0	400 EUR	82.45%	329'784.00	0.05	a)
FR0014000UL9	0.6250 % BNP 0 5/8 12/03/32 EMTN	500	0	0	500 EUR	75.48%	377'390.00	0.05	a)
FR0014000XY6	0.3750 % CNPFP 0 3/8 03/08/28	200	0	0	200 EUR	87.07%	174'138.00	0.02	a)
FR0014000Y93	0.1250 % ACAFP 0 1/8 12/09/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	87.82%	263'457.00	0.04	a)
FR0014001EW8	0.0000 % ALOFP 0 01/11/29	0	300	0	300 EUR	81.36%	244'071.00	0.03	a)
FR0014001EW8XXX	0.0000 % *RETIRED*	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014001G29	0.0100 % BPCEGP 0.01 01/14/27	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014001G37	0.2500 % BPCEGP 0 1/4 01/14/31	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014001GA9	0.5000 % SOCGEN 0 1/2 06/12/29	300	0	0	300 EUR	86.15%	258'456.00	0.04	a)
FR0014001I68	0.2500 % BFCM 0 1/4 07/19/28	300	0	0	300 EUR	85.69%	257'070.00	0.04	a)
FR0014001IM0	0.6250 % ICADFP 0 5/8 01/18/31	200	0	0	200 EUR	77.44%	154'878.00	0.02	a)
FR0014001JP1	0.0000 % BSTLAF 0 01/22/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.87%	193'732.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR0014001JT3	0.5000 % BNP 0 1/2 01/19/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	84.80%	254'391.00	0.03	a)
FR0014001R34	0.7500 % FRLBP 0 3/4 08/02/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.04%	176'078.00	0.02	a)
FR00140022B3	0.1250 % SOCGEN 0 1/8 02/18/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	87.32%	261'969.00	0.04	a)
FR00140027U2	0.7500 % BPCEGP 0 3/4 03/03/31 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014002BJ9	0.8750 % CMARK 0 7/8 03/11/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	77.64%	155'282.00	0.02	a)
FR0014002C30	0.0000 % VIEFP 0 06/09/26 EMTN	600	0	0	600 EUR	92.38%	554'280.00	0.08	a)
FR0014002NR7	0.0000 % ARVASL 0 09/30/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014002QE8	1.1250 % SOCGEN 1 1/8 06/30/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.14%	184'276.00	0.03	a)
FR0014002S57	0.0100 % BFCM 0.01 05/11/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	92.41%	369'644.00	0.05	a)
FR0014002X43	0.2500 % BNP 0 1/4 04/13/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.50%	277'509.00	0.04	a)
FR0014003182	0.3750 % ACAFP 0 3/8 04/20/28 EMTN	0	800	0	800 EUR	87.41%	699'312.00	0.10	a)
FR0014003B55	1.3750 % ORAFP 1 3/8 PERP EMTN	100	0	0	100 EUR	85.25%	85'250.00	0.01	a)
FR0014003G27	1.6250 % VRLAFP 1 5/8 05/14/28	0	100	0	100 EUR	91.16%	91'158.00	0.01	a)
FR0014003MI6	1.3750 % URWFP 1 3/8 05/25/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	80.10%	160'204.00	0.02	a)
FR0014003N69	0.3750 % AIFP 0 3/8 05/27/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.79%	81'793.00	0.01	a)
FR0014003OB7	0.9500 % IDFMOB 0.95 05/28/41 EMTN	100	100	0	200 EUR	66.60%	133'190.00	0.02	a)
FR0014003OC5	0.4000 % IDFMOB 0.4 05/28/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	82.61%	165'222.00	0.02	a)
FR0014003Q41	0.0000 % BNFP 0 12/01/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.25%	188'506.00	0.03	a)
FR0014003SA0	0.6250 % BFCM 0 5/8 11/03/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	86.32%	345'268.00	0.05	a)
FR0014003XZ7	2.1250 % MACIFS 2 1/8 06/21/52	300	0	0	300 EUR	77.10%	231'294.00	0.03	a)
FR0014003Y09	0.6250 % MACIFS 0 5/8 06/21/27	100	0	0	100 EUR	89.76%	89'756.00	0.01	a)
FR00140044X1	0.7500 % FRLBP 0 3/4 06/23/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.08%	162'156.00	0.02	a)
FR0014004750	0.2500 % BFCM 0 1/4 06/29/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.99%	86'991.00	0.01	a)
FR00140049A8	0.8750 % GFCFP 0 7/8 06/30/36 EMTN	200	0	0	200 EUR	71.99%	143'984.00	0.02	a)
FR00140049Z5	0.0000 % ORAFP 0 06/29/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.24%	184'472.00	0.03	a)
FR0014004A06	0.7500 % ORAFP 0 3/4 06/29/34 EMTN	300	0	0	300 EUR	76.75%	230'235.00	0.03	a)
FR0014004FR9	0.5000 % DGFP 0 1/2 01/09/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	79.89%	159'772.00	0.02	a)
FR0014004GE5	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 07/08/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.36%	268'071.00	0.04	a)
FR0014004JA7	0.7500 % ALSFR 0 3/4 07/19/41 EMTN	300	0	0	300 EUR	63.12%	189'369.00	0.03	a)
FR0014004QI5	1.0000 % FMUFP 1 07/27/29	200	0	0	200 EUR	87.22%	174'436.00	0.02	a)
FR0014004QX4	0.1250 % ALOFP 0 1/8 07/27/27	100	0	0	100 EUR	88.15%	88'147.00	0.01	a)
FR0014004R72	0.5000 % ALOFP 0 1/2 07/27/30	200	0	0	200 EUR	79.65%	159'308.00	0.02	a)
FR00140057U9	0.8750 % BNP 0 7/8 08/31/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.13%	170'264.00	0.02	a)
FR0014005HY8	0.3750 % AIFP 0 3/8 09/20/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	76.64%	153'288.00	0.02	a)
FR0014005J14	0.5000 % ACAFP 0 1/2 09/21/29 EMTN	0	600	0	600 EUR	86.10%	516'570.00	0.07	a)
FR0014005OK3	0.3750 % LRF 0 3/8 10/06/31	100	0	0	100 EUR	81.72%	81'722.00	0.01	a)
FR0014005OL1	0.0000 % ARVASL 0 10/01/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014005SC1	0.1250 % RIFP 0 1/8 10/04/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	83.76%	167'518.00	0.02	a)
FR0014005SE7	0.3750 % ALSFR 0 3/8 10/05/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	81.60%	244'809.00	0.03	a)
FR0014005X99	1.8750 % CNPFP 1 7/8 10/12/53 EMTN	200	0	0	200 EUR	77.67%	155'342.00	0.02	a)
FR0014005ZP8	0.3750 % ENGIFP 0 3/8 10/26/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	83.58%	250'743.00	0.03	a)
FR0014005ZQ6	1.0000 % ENGIFP 1 10/26/36 EMTN	400	0	0	400 EUR	71.57%	286'268.00	0.04	a)
FR00140060E7	0.5000 % FLYFP 0 1/2 04/21/28	200	0	0	200 EUR	88.00%	175'990.00	0.02	a)
FR0014006144	1.8500 % BFCM 1.85 04/21/42	100	200	0	300 EUR	79.99%	239'982.00	0.03	a)
FR00140065E6	0.8750 % CMARK 0 7/8 10/25/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.82%	161'638.00	0.02	a)
FR0014006CS9	0.5000 % ENFP 0 1/2 02/11/30	200	0	0	200 EUR	84.68%	169'352.00	0.02	a)
FR0014006EGO	1.8750 % VRLAFP 1 7/8 11/10/31	0	200	0	200 EUR	85.16%	170'322.00	0.02	a)
FR0014006FB8	1.0110 % ARGFP 1.011 11/17/26	0	200	0	200 EUR	89.46%	178'918.00	0.02	a)
FR0014006FE2	0.5200 % BNFP 0.52 11/09/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	82.88%	165'760.00	0.02	a)
FR0014006IG1	1.0810 % CRLOG 1.081 02/15/34 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.91%	171'818.00	0.02	a)
FR0014006IU2	0.1250 % SOCGEN 0 1/8 11/17/26	300	0	0	300 EUR	93.96%	281'886.00	0.04	a)
FR0014006IV0	0.0000 % ARFP 0 06/19/28 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014006IX6	2.0000 % VIEFP 2 PERP	300	0	0	300 EUR	89.59%	268'761.00	0.04	a)
FR0014006KD4	1.1250 % BFCM 1 1/8 11/19/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.91%	157'828.00	0.02	a)
FR0014006ND8	2.3750 % ACFP 2 3/8 11/29/28	0	200	0	200 EUR	93.68%	187'350.00	0.03	a)
FR0014006NI7	0.5000 % BNP 0 1/2 05/30/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.81%	269'424.00	0.04	a)
FR0014006PN2	0.6750 % IDFMOB 0.675 11/24/36 EMTN	200	0	0	200 EUR	71.91%	143'814.00	0.02	a)
FR0014006UO0	1.0000 % EDF 1 11/29/33 EMTN	0	600	0	600 EUR	76.99%	461'928.00	0.06	a)
FR0014006XA3	0.6250 % SOCGEN 0 5/8 12/02/27	300	0	0	300 EUR	91.29%	273'867.00	0.04	a)
FR0014006XE5	0.0100 % BFCM 0.01 03/07/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	96.30%	481'505.00	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR0014006ZC4	0.6250 % ORAFP 0 5/8 12/16/33 EMTN	500	0	0	500 EUR	76.79%	383'955.00	0.05	a)
FR0014007KL5	0.5000 % RENAUL 0 1/2 07/14/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.47%	190'936.00	0.03	a)
FR0014007LK5	0.8750 % BNP 0 7/8 07/11/30 EMTN	400	100	0	500 EUR	85.20%	425'985.00	0.06	a)
FR0014007LL3	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 01/14/28 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014007LM1	1.0000 % BPCEGP 1 01/14/32 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014007LP4	0.7500 % RTEFRA 0 3/4 01/12/34 EMTN	0	300	0	300 EUR	76.93%	230'802.00	0.03	a)
FR0014007MK3	1.1250 % ACAFP 1 1/8 07/12/32 EMTN	0	300	0	300 EUR	81.89%	245'670.00	0.03	a)
FR0014007ML1	0.6250 % ACAFP 0 5/8 01/12/28	0	300	0	300 EUR	91.29%	273'867.00	0.04	a)
FR0014007NF1	1.0000 % ICADFP 1 01/19/30	0	200	0	200 EUR	83.08%	166'158.00	0.02	a)
FR0014007PV3	0.6250 % BFCM 0 5/8 11/19/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.17%	267'507.00	0.04	a)
FR0014007PW1	1.1250 % BFCM 1 1/8 01/19/32 EMTN	400	0	0	400 EUR	81.87%	327'480.00	0.04	a)
FR0014007Q96	0.7500 % CMARK 0 3/4 01/18/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	84.74%	84'742.00	0.01	a)
FR0014007VF4	0.3750 % BPCEGP 0 3/8 02/02/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014007YA9	1.2500 % CNPFP 1 1/4 01/27/29	100	100	0	200 EUR	87.71%	175'410.00	0.02	a)
FR00140082Z6	1.6250 % DECFP 1 5/8 02/07/30	0	100	0	100 EUR	87.17%	87'165.00	0.01	a)
FR00140087C4	1.0000 % FRLBP 1 02/09/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	91.65%	274'941.00	0.04	a)
FR0014008CP1	1.2750 % IDFMOB 1.275 02/14/42 EMTN	200	0	0	200 EUR	69.57%	139'140.00	0.02	a)
FR0014008CQ9	0.9500 % IDFMOB 0.95 02/16/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	84.70%	84'700.00	0.01	a)
FR0014008FH1	0.8750 % ARVASL 0 7/8 02/17/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014008MT2	1.1250 % ACAFP 1 1/8 02/24/29 EMTN	0	900	0	900 EUR	89.61%	806'526.00	0.11	a)
FR0014008PC1	2.2500 % BPCEGP 2 1/4 03/02/32 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014008PK4	1.6250 % BPCEGP 1 5/8 03/02/29	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR00140098S7	1.0000 % ACAFP 1 09/18/25 EMTN	0	400	0	400 EUR	96.15%	384'584.00	0.05	a)
FR0014009A50	1.0000 % BFCM 1 05/23/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.68%	290'025.00	0.04	a)
FR0014009DZ6	1.8750 % CAFP 1 7/8 10/30/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.72%	95'715.00	0.01	a)
FR0014009E07	2.3750 % CAFP 2 3/8 10/30/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.78%	187'560.00	0.03	a)
FR0014009EI0	0.3750 % ORFP 0 3/8 03/29/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014009EJ8	0.8750 % ORFP 0 7/8 06/29/26	400	0	0	400 EUR	94.65%	378'592.00	0.05	a)
FR0014009HA0	2.5000 % BNP 2 1/2 03/31/32 EMTN	500	0	0	500 EUR	93.92%	469'600.00	0.06	a)
FR0014009KQ0	1.2500 % SANFP 1 1/4 04/06/29	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014009L57	1.3750 % RIFP 1 3/8 04/07/29	200	0	0	200 EUR	90.55%	181'090.00	0.02	a)
FR0014009LQ8	2.1000 % BNP 2.1 04/07/32 EMTN	500	0	0	500 EUR	87.61%	438'045.00	0.06	a)
FR0014009N55	1.3750 % ALSFR 1 3/8 04/13/32 EMTN	200	200	0	400 EUR	86.88%	347'508.00	0.05	a)
FR0014009UH8	1.8750 % ACAFP 1 7/8 04/22/27	0	500	0	500 EUR	95.99%	479'960.00	0.07	a)
FR0014009UQ9	2.5000 % ACAFP 2 1/2 04/22/34	0	200	0	200 EUR	89.73%	179'454.00	0.02	a)
FR0014009YC1	2.3750 % BPCEGP 2 3/8 04/26/32 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014009YD9	1.7500 % BPCEGP 1 3/4 04/26/27 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400A1H6	3.5000 % ENGIFP 3 1/2 09/27/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.27%	198'536.00	0.03	a)
FR001400A3G4	2.6250 % BFCM 2 5/8 11/06/29 EMTN	200	100	0	300 EUR	93.56%	280'674.00	0.04	a)
FR001400A5M7	1.8750 % KERFP 1 7/8 05/05/30 EMTN	200	200	0	400 EUR	91.52%	366'064.00	0.05	a)
FR001400AF72	2.3750 % ORAFP 2 3/8 05/18/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.81%	92'806.00	0.01	a)
FR001400AFL5	1.8750 % SUEZFP 1 7/8 05/24/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.49%	188'982.00	0.03	a)
FR001400AFN1	2.3750 % SUEZFP 2 3/8 05/24/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.42%	184'848.00	0.03	a)
FR001400AFO9	2.8750 % SUEZFP 2 7/8 05/24/34 EMTN	300	0	0	300 EUR	91.64%	274'932.00	0.04	a)
FR001400AJX2	2.2500 % ENFP 2 1/4 06/29/29	100	200	0	300 EUR	94.43%	283'281.00	0.04	a)
FR001400AJY0	3.2500 % ENFP 3 1/4 06/30/37	300	0	0	300 EUR	95.86%	287'586.00	0.04	a)
FR001400AKP6	2.7500 % BNP 2 3/4 07/25/28 EMTN	500	0	0	500 EUR	96.11%	480'565.00	0.07	a)
FR001400AO14	2.6250 % SOCGEN 2 5/8 05/30/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.56%	286'683.00	0.04	a)
FR001400AOL7	1.8750 % ARRF 1 7/8 01/03/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400ASK0	3.7500 % RCFFP 3 3/4 06/24/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.39%	190'788.00	0.03	a)
FR001400AY79	3.8750 % BFCM 3 7/8 06/16/32	300	0	0	300 EUR	97.71%	293'130.00	0.04	a)
FR001400B1L7	4.7500 % RENAUL 4 3/4 07/06/27 EMTN	0	150	0	150 EUR	102.19%	153'286.50	0.02	a)
FR001400BDD5	3.3750 % ARVASL 3 3/8 01/04/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400CEQ3	2.5000 % ACAFP 2 1/2 08/29/29 EMTN	0	700	0	700 EUR	94.88%	664'167.00	0.09	a)
FR001400CFW8	3.6250 % BNP 3 5/8 09/01/29 EMTN	200	300	0	500 EUR	98.99%	494'940.00	0.07	a)
FR001400CH94	2.7500 % DGFP 2 3/4 09/02/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.94%	284'820.00	0.04	a)
FR001400CHR4	6.2500 % MACIFS 6 1/4 09/09/33	0	200	0	200 EUR	108.16%	216'318.00	0.03	a)
FR001400CJG3	3.0710 % BNFP 3.071 09/07/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.15%	194'308.00	0.03	a)
FR001400CKA4	5.2500 % SOCGEN 5 1/4 09/06/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	102.10%	204'208.00	0.03	a)
FR001400CKB2	2.8750 % SAGESS 2 7/8 09/07/32 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400CMY0	3.1250 % BFCM 3 1/8 09/14/27 EMTN	200	200	0	400 EUR	98.43%	393'712.00	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR001400CMZ7	3.6250 % BFCM 3 5/8 09/14/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	99.66%	298'980.00	0.04	a)
FR001400CND2	2.8750 % AIFP 2 7/8 09/16/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.59%	193'184.00	0.03	a)
FR001400CQ85	3.3750 % CMARK 3 3/8 09/19/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	99.17%	396'680.00	0.05	a)
FR001400CRG6	4.8750 % RENAUL 4 7/8 09/21/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	103.49%	310'455.00	0.04	a)
FR001400CSG4	4.0000 % ARVASL 4 09/22/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400CWI2	3.1250 % ALSFR 3 1/8 09/28/37 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.97%	189'930.00	0.03	a)
FR001400D0F9	4.1250 % CAFP 4 1/8 10/12/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	102.56%	205'110.00	0.03	a)
FR001400D0Y0	4.0000 % ACAFP 4 10/12/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.17%	300'507.00	0.04	a)
FR001400D6M2	3.8750 % EDF 3 7/8 01/12/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.35%	301'038.00	0.04	a)
FR001400D6N0	4.3750 % EDF 4 3/8 10/12/29 EMTN	0	400	0	400 EUR	103.49%	413'972.00	0.06	a)
FR001400D6O8	4.7500 % EDF 4 3/4 10/12/34 EMTN	0	500	0	500 EUR	106.15%	530'760.00	0.07	a)
FR001400D7M0	4.7500 % ALDFP 4 3/4 10/13/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.18%	101'184.00	0.01	a)
FR001400D8K2	3.3750 % DGFP 3 3/8 10/17/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.94%	197'880.00	0.03	a)
FR001400DAO4	5.3750 % ORANOF 5 3/8 05/15/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	103.87%	103'869.00	0.01	a)
FR001400DCZ6	4.3750 % BNP 4 3/8 01/13/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.88%	305'634.00	0.04	a)
FR001400DLD4	5.5000 % FRLBP 5 1/2 03/05/34 EMTN	100	100	0	200 EUR	103.34%	206'686.00	0.03	a)
FR001400DNF5	5.3750 % ENFP 5 3/8 06/30/42	300	0	0	300 EUR	116.85%	350'562.00	0.05	a)
FR001400DNG3	4.6250 % ENFP 4 5/8 06/07/32	400	0	0	400 EUR	107.45%	429'784.00	0.06	a)
FR001400DOV0	3.2500 % RIFP 3 1/4 11/02/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	99.44%	198'878.00	0.03	a)
FR001400DP44	3.7500 % RIFP 3 3/4 11/02/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	101.66%	101'661.00	0.01	a)
FR001400DQ84	4.6250 % SUEZFP 4 5/8 11/03/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	103.94%	207'876.00	0.03	a)
FR001400DQ92	5.0000 % SUEZFP 5 11/03/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	108.10%	324'285.00	0.04	a)
FR001400DT99	3.2500 % SUFP 3 1/4 11/09/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	99.73%	99'726.00	0.01	a)
FR001400DTA3	3.5000 % SUFP 3 1/2 11/09/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	100.63%	201'264.00	0.03	a)
FR001400DY43	3.6250 % ORAFP 3 5/8 11/16/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	101.29%	101'287.00	0.01	a)
FR001400DZM5	4.0000 % SOCGEN 4 11/16/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	101.02%	303'057.00	0.04	a)
FR001400DZN3	4.0000 % BFCM 4 11/21/29 EMTN	200	100	0	300 EUR	101.97%	305'913.00	0.04	a)
FR001400DZO1	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 11/16/32 EMTN	400	0	0	400 EUR	104.55%	418'216.00	0.06	a)
FR001400E3H8	4.7500 % ARVASL 4 3/4 05/22/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400E797	4.0000 % BPCEGP 4 11/29/32 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400E7I7	3.8750 % ACAFP 3 7/8 11/28/34 EMTN	0	500	0	500 EUR	101.64%	508'175.00	0.07	a)
FR001400E7J5	3.3750 % ACAFP 3 3/8 07/28/27 EMTN	0	800	0	800 EUR	99.44%	795'544.00	0.11	a)
FR001400E904	4.1250 % RENAUL 4 1/8 12/01/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.22%	200'442.00	0.03	a)
FR001400E946	4.2500 % CMARK 4 1/4 12/01/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.40%	206'804.00	0.03	a)
FR001400EA16	5.3750 % FRFP 5 3/8 05/28/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	103.00%	308'997.00	0.04	a)
FR001400EAY1	3.7500 % BFCM 3 3/4 02/01/33 EMTN	400	100	0	500 EUR	100.50%	502'510.00	0.07	a)
FR001400EHG3	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 12/06/30 EMTN	400	100	0	500 EUR	100.43%	502'170.00	0.07	a)
FR001400EHH1	4.8750 % ELOFR 4 7/8 12/08/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	96.92%	290'763.00	0.04	a)
FR001400F075	4.3750 % BPCEGP 4 3/8 07/13/28 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400F083	4.5000 % BPCEGP 4 1/2 01/13/33 EMTN	300	100	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400F0H3	5.0000 % DECFP 5 01/11/29	0	200	0	200 EUR	104.53%	209'064.00	0.03	a)
FR001400F0U6	4.6250 % RENAUL 4 5/8 07/13/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.07%	303'198.00	0.04	a)
FR001400F0V4	3.8750 % BNP 3 7/8 01/10/31 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.24%	303'714.00	0.04	a)
FR001400F1G3	3.6250 % ENGIFP 3 5/8 01/11/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	99.79%	299'364.00	0.04	a)
FR001400F1I9	4.0000 % ENGIFP 4 01/11/35 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.72%	199'430.00	0.03	a)
FR001400F1M1	4.2500 % ENGIFP 4 1/4 01/11/43 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.13%	300'375.00	0.04	a)
FR001400F1U4	4.2500 % ACAFP 4 1/4 07/11/29	0	500	0	500 EUR	101.41%	507'025.00	0.07	a)
FR001400F3Z3	5.1250 % BFCM 5 1/8 01/13/33 EMTN	0	100	0	100 EUR	104.79%	104'790.00	0.01	a)
FR001400F5F6	4.3750 % FRLBP 4 3/8 01/17/30 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.74%	305'220.00	0.04	a)
FR001400F6Z0	5.2500 % CNPFP 5 1/4 07/18/53 EMTN	100	100	0	200 EUR	102.19%	204'386.00	0.03	a)
FR001400F6E7	4.2500 % ALDFP 4 1/4 01/18/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.67%	302'007.00	0.04	a)
FR001400F6O6	4.1250 % ARVASL 4 1/8 04/13/26 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400F703	3.1250 % SUFP 3 1/8 10/13/29 EMTN	200	100	0	300 EUR	99.18%	297'546.00	0.04	a)
FR001400F711	3.3750 % SUFP 3 3/8 04/13/34 EMTN	100	0	0	100 EUR	99.72%	99'715.00	0.01	a)
FR001400F7K2	4.0000 % ACAFP 4 01/18/33 EMTN	0	300	0	300 EUR	103.02%	309'072.00	0.04	a)
FR001400F8Z8	3.2500 % DGFP 3 1/4 01/19/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.98%	195'950.00	0.03	a)
FR001400FB06	3.5000 % BPCEGP 3 1/2 01/25/28 EMTN	300	100	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FB22	5.1250 % BPCEGP 5 1/8 01/25/35 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400FBN9	3.8750 % BFCM 3 7/8 01/26/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.06%	200'120.00	0.03	a)
FR001400FBR0	4.0000 % BFCM 4 01/26/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.83%	201'664.00	0.03	a)
FR001400FDB0	4.2500 % EDF 4 1/4 01/25/32 EMTN	0	400	0	400 EUR	102.93%	411'728.00	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR001400FDC8	4.6250 % EDF 4 5/8 01/25/43 EMTN	0	300	0	300 EUR	103.29%	309'873.00	0.04	a)
FR001400FT11	3.6250 % ALSFR 3 5/8 05/25/43 EMTN	0	400	0	400 EUR	98.46%	393'848.00	0.05	a)
FR001400G3A1	3.8750 % BNP 3 7/8 02/23/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.98%	201'964.00	0.03	a)
FR001400G3Y1	3.2500 % KERFP 3 1/4 02/27/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	99.42%	298'251.00	0.04	a)
FR001400G412	3.3750 % KERFP 3 3/8 02/27/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	98.35%	196'692.00	0.03	a)
FR001400G6Y4	4.6250 % BPCEGP 4 5/8 03/02/30	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400GDF9	4.1250 % ACAFP 4 1/8 03/07/30 EMTN	0	800	0	800 EUR	103.10%	824'760.00	0.11	a)
FR001400GDJ1	5.3750 % ORAFP 5 3/8 PERP EMTN	0	200	0	200 EUR	104.08%	208'166.00	0.03	a)
FR001400GGZ0	4.1250 % BFCM 4 1/8 03/13/29 EMTN	0	500	0	500 EUR	102.15%	510'760.00	0.07	a)
FR001400H2O3	4.5000 % RENAUL 4 1/2 04/06/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.26%	202'510.00	0.03	a)
FR001400H9B5	4.2500 % BNP 4 1/4 04/13/31 EMTN	0	400	0	400 EUR	102.34%	409'344.00	0.06	a)
FR001400HAC0	3.6250 % BPCEGP 3 5/8 04/17/26 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400HCR4	3.8750 % ACAFP 3 7/8 04/20/31 EMTN	0	900	0	900 EUR	101.65%	914'877.00	0.13	a)
FR001400HMF8	4.3750 % BFCM 4 3/8 05/02/30 EMTN	0	400	0	400 EUR	102.13%	408'520.00	0.06	a)
FR001400HOZ2	4.0000 % FRLBP 4 05/03/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.21%	202'412.00	0.03	a)
FR001400HQM5	4.0790 % CAFP 4.079 05/05/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.34%	200'674.00	0.03	a)
FR001400HU68	3.7500 % CAFP 3 3/4 10/10/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.33%	200'668.00	0.03	a)
FR001400HX81	2.8750 % ORFP 2 7/8 05/19/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	98.63%	295'890.00	0.04	a)
FR001400H186	3.8750 % CMARK 3 7/8 05/22/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.83%	201'662.00	0.03	a)
FR001400I3C5	3.4700 % BNF 3.47 05/22/31 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.07%	300'195.00	0.04	a)
FR001400I4X9	4.1250 % BNP 4 1/8 05/24/33 EMTN	0	400	0	400 EUR	103.96%	415'836.00	0.06	a)
FR001400I5S6	3.5000 % LRFP 3 1/2 05/29/29	0	200	0	200 EUR	100.82%	201'636.00	0.03	a)
FR001400IBM5	3.8750 % ENFP 3 7/8 07/17/31	0	300	0	300 EUR	102.37%	307'113.00	0.04	a)
FR001400IDW0	4.1250 % SOCGEN 4 1/8 06/02/27	0	400	0	400 EUR	101.32%	405'276.00	0.06	a)
FR001400IDY6	5.6250 % SOCGEN 5 5/8 06/02/33 EMTN	0	400	0	400 EUR	105.51%	422'040.00	0.06	a)
FR001400IEQ0	4.8750 % RENAUL 4 7/8 06/14/28 EMTN	0	250	0	250 EUR	103.00%	257'510.00	0.04	a)
FR001400IFX3	3.8750 % BFCM 3 7/8 02/14/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.08%	202'150.00	0.03	a)
FR001400IG08	4.1250 % BFCM 4 1/8 06/14/33 EMTN	0	400	0	400 EUR	102.89%	411'552.00	0.06	a)
FR001400IIT5	3.6250 % EDENFP 3 5/8 12/13/26	0	200	0	200 EUR	99.72%	199'438.00	0.03	a)
FR001400IUI3	3.6250 % EDENFP 3 5/8 06/13/31	0	200	0	200 EUR	98.51%	197'026.00	0.03	a)
FR001400IUI3	4.7500 % BPCEGP 4 3/4 06/14/34 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR001400IUT3	3.2500 % SUFP 3 1/4 06/12/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.92%	199'848.00	0.03	a)
FR001400IUU1	3.5000 % SUFP 3 1/2 06/12/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.72%	201'438.00	0.03	a)
FR001400IKC7	3.7000 % IDFMOB 3.7 06/14/38 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.05%	204'096.00	0.03	a)
FR001400IUR3	7.2500 % URWFP 7 1/4 PERP	0	200	0	200 EUR	104.00%	208'000.00	0.03	a)
FR001400J150	3.7500 % RTEFRA 3 3/4 07/04/35 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.96%	302'886.00	0.04	a)
FR001400KDS4	5.5000 % ACAFP 5 1/2 08/28/33 EMTN	0	300	0	300 EUR	103.73%	311'199.00	0.04	a)
FR001400KHG0	3.8750 % ENGIFP 3 7/8 01/06/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.70%	100'697.00	0.01	a)
FR001400KHH8	4.2500 % ENGIFP 4 1/4 09/06/34 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.34%	204'674.00	0.03	a)
FR001400KH16	4.5000 % ENGIFP 4 1/2 09/06/42 EMTN	0	300	0	300 EUR	103.50%	310'506.00	0.04	a)
FR001400KHW7	3.6250 % KERFP 3 5/8 09/05/31 EMTN	0	400	0	400 EUR	100.71%	402'848.00	0.06	a)
FR001400KHXS	3.8750 % KERFP 3 7/8 09/05/35 EMTN	0	400	0	400 EUR	101.67%	406'696.00	0.06	a)
FR001400KHZ0	3.6250 % KERFP 3 5/8 09/05/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.60%	301'797.00	0.04	a)
FR001400KJ00	3.5000 % MCFP 3 1/2 09/07/33 EMTN	0	500	0	500 EUR	101.32%	506'600.00	0.07	a)
FR001400KJP7	3.2500 % MCFP 3 1/4 09/07/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	99.95%	299'844.00	0.04	a)
FR001400KKC3	5.9930 % VIEFP 5.993 PERP	0	200	0	200 EUR	104.47%	208'944.00	0.03	a)
FR001400KKM2	3.8750 % ORAFP 3 7/8 09/11/35 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.85%	205'696.00	0.03	a)
FR001400KL23	5.5000 % PRAEFP 5 1/2 09/19/28	0	200	0	200 EUR	104.33%	208'666.00	0.03	a)
FR001400KLT5	4.1250 % WLNFP 4 1/8 09/12/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	96.95%	193'902.00	0.03	a)
FR001400KO38	4.1250 % BFCM 4 1/8 09/18/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.87%	205'744.00	0.03	a)
FR001400KPB4	3.7500 % RIFP 3 3/4 09/15/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.96%	201'912.00	0.03	a)
FR001400KPC2	3.7500 % RIFP 3 3/4 09/15/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.41%	202'820.00	0.03	a)
FR001400KSZ7	5.8750 % ACAFP 5 7/8 10/25/33	0	200	0	200 EUR	109.26%	218'514.00	0.03	a)
FR001400KWR6	6.0000 % ELOFR 6 03/22/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.02%	200'032.00	0.03	a)
FR001400KY44	4.1250 % BNP 4 1/8 09/26/32 EMTN	0	500	0	500 EUR	102.83%	514'165.00	0.07	a)
FR001400KY69	4.8750 % RENAUL 4 7/8 10/02/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.47%	206'936.00	0.03	a)
FR001400KZP3	4.2500 % SOCGEN 4 1/4 09/28/26	0	500	0	500 EUR	101.34%	506'700.00	0.07	a)
FR001400KZQ1	4.7500 % SOCGEN 4 3/4 09/28/29	0	300	0	300 EUR	102.53%	307'602.00	0.04	a)
FR001400KZZ2	4.1250 % CMARK 4 1/8 04/02/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.77%	205'538.00	0.03	a)
FR001400L1E0	5.5000 % CARDFP 5 1/2 10/09/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	104.16%	208'328.00	0.03	a)
FR001400L362	4.1250 % ALSFR 4 1/8 10/03/38 EMTN	0	300	0	300 EUR	105.44%	316'308.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR001400L4V8	4.8750 % ALDFP 4 7/8 10/06/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	103.84%	311'532.00	0.04	a)
FR001400L9Q7	5.8750 % FRFP 5 7/8 04/12/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	105.30%	210'594.00	0.03	a)
FR001400LCK1	4.5000 % VPARKI 4 1/2 04/18/30	0	200	0	200 EUR	102.78%	205'558.00	0.03	a)
FR001400LUK3	4.3750 % CAFP 4 3/8 11/14/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.12%	206'230.00	0.03	a)
FR001400LWN3	4.7500 % BFCM 4 3/4 11/10/31 EMTN	0	400	0	400 EUR	104.70%	418'792.00	0.06	a)
FR001400LZ16	4.7500 % BNP 4 3/4 11/13/32 EMTN	0	500	0	500 EUR	104.56%	522'810.00	0.07	a)
FR001400M1X9	6.5000 % SOGESA 6 1/2 05/16/44	0	300	0	300 EUR	107.98%	323'943.00	0.04	a)
FR001400M2F4	5.2500 % RCFFP 5 1/4 11/22/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.79%	302'376.00	0.04	a)
FR001400M2G2	5.7500 % RCFFP 5 3/4 11/22/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.24%	204'488.00	0.03	a)
FR001400M2R9	4.2500 % AKEFP 4 1/4 05/20/30 EMTN	0	300	0	300 EUR	103.18%	309'531.00	0.04	a)
FR001400M4O2	4.3750 % ACAFP 4 3/8 11/27/33 EMTN	0	400	0	400 EUR	103.52%	414'080.00	0.06	a)
FR001400M6F5	4.8750 % SOCGEN 4 7/8 11/21/31	0	400	0	400 EUR	103.43%	413'716.00	0.06	a)
FR001400M6G3	4.1250 % SOCGEN 4 1/8 11/21/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	102.04%	306'114.00	0.04	a)
FR001400M6K5	3.3750 % ORFP 3 3/8 01/23/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.31%	300'918.00	0.04	a)
FR001400M6L3	3.3750 % ORFP 3 3/8 11/23/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.83%	201'662.00	0.03	a)
FR001400M8T2	4.3750 % ALDFP 4 3/8 11/23/26	0	200	0	200 EUR	100.71%	201'414.00	0.03	a)
FR001400M998	4.7500 % NK 4 3/4 11/29/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.54%	101'539.00	0.01	a)
FR001400M9L7	3.7500 % EDF 3 3/4 06/05/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.34%	301'014.00	0.04	a)
FR001400MCE2	4.1250 % CMARK 4 1/8 02/01/34 EMTN	0	100	0	100 EUR	103.38%	103'379.00	0.01	a)
FR001400MDV4	4.6250 % COVFP 4 5/8 06/05/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.43%	204'864.00	0.03	a)
FR001400MF78	3.6250 % ENGIFP 3 5/8 12/06/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.90%	199'806.00	0.03	a)
FR001400MF86	3.8750 % ENGIFP 3 7/8 12/06/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.98%	199'964.00	0.03	a)
FR001400MIG4	3.5000 % RTEFRA 3 1/2 12/07/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.28%	200'558.00	0.03	a)
FR001400N285	3.2500 % SUFP 3 1/4 10/10/35 EMTN	0	300	0	300 EUR	97.65%	292'944.00	0.04	a)
FR001400N2M9	3.7500 % ACAFP 3 3/4 01/22/34 EMTN	0	400	0	400 EUR	100.21%	400'856.00	0.06	a)
FR001400N3I5	4.3750 % BFCM 4 3/8 01/11/34 EMTN	0	500	0	500 EUR	98.02%	490'100.00	0.07	a)
FR001400N4G7	4.0420 % BNP 4.042 01/10/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.08%	200'164.00	0.03	a)
FR001400N6I8	3.7500 % BFCM 3 3/4 02/03/34 EMTN	0	300	0	300 EUR	99.44%	298'329.00	0.04	a)
FR001400N8H6	3.7500 % CTEFRA 3 3/4 01/17/36	0	300	0	300 EUR	99.06%	297'174.00	0.04	a)
FR001400NC70	3.8750 % ALDFP 3 7/8 01/24/28	0	200	0	200 EUR	99.61%	199'226.00	0.03	a)
FR001400NC88	4.0000 % ALDFP 4 01/24/31	0	200	0	200 EUR	99.26%	198'522.00	0.03	a)
IT0005521171	4.3000 % ENIIM 4.3 02/10/28	0	550	0	550 EUR	102.06%	561'319.00	0.08	a)
IT0005570988	4.6000 % UCGIM 4.6 02/14/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.21%	206'410.00	0.03	a)
IT0006729377	2.8000 % BACR 2.8 06/20/24 DMTN	200	0	0	200 EUR	99.62%	199'234.00	0.03	a)
PTBCP2OM0058	5.6250 % BCPPL 5 5/8 10/02/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.75%	203'500.00	0.03	a)
PTBCPEOM0069	1.7500 % BCPPL 1 3/4 04/07/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.88%	185'750.00	0.03	a)
PTCGDCOM0037	0.3750 % CXGD 0 3/8 09/21/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.99%	183'984.00	0.03	a)
PTCGDDOM0036	5.7500 % CXGD 5 3/4 10/31/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	106.32%	106'322.00	0.01	a)
PTEDPNOM0015	1.6250 % EDPL 1 5/8 04/15/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.49%	188'976.00	0.03	a)
PTEDPUOM0008	3.8750 % EDPL 3 7/8 06/26/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.94%	100'939.00	0.01	a)
XS0161488498	7.5000 % DT 7 1/2 01/24/33 EMTN	230	0	230	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0162869076	5.8750 % TELEFO 5 7/8 02/14/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	115.10%	115'103.00	0.02	a)
XS0162990229	5.6250 % EDF 5 5/8 02/21/33 EMTN	0	100	0	100 EUR	114.12%	114'119.00	0.02	a)
XS0191154961	5.3750 % VATFAL 5 3/8 04/29/24 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0192503695	5.2500 % ENELIM 5 1/4 05/20/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0193945655	5.8750 % ATOSTR 5 7/8 06/09/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0203712939	4.9000 % TRNIM 4.9 10/28/24	210	0	0	210 EUR	100.69%	211'451.10	0.03	a)
XS0207320242	4.8750 % ENBW 4 7/8 01/16/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	101.02%	101'023.00	0.01	a)
XS0222383027	4.0000 % GSK 4 06/16/25 EMTN	485	0	0	485 EUR	100.34%	486'663.55	0.07	a)
XS0229567440	4.1250 % GE 4 1/8 09/19/35 EMTN	0	100	0	100 EUR	102.15%	102'152.00	0.01	a)
XS0300113254	4.8750 % PG 4 7/8 05/11/27	307	0	0	307 EUR	105.03%	322'435.96	0.04	a)
XS0306646042	5.6250 % ENELIM 5 5/8 06/21/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	106.40%	425'612.00	0.06	a)
XS0418669429	5.1250 % TTEFP 5 1/8 03/26/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0438844093	6.1250 % ENBW 6 1/8 07/07/39 EMTN	200	0	0	200 EUR	123.54%	247'080.00	0.03	a)
XS0452314536	5.1250 % ASSGEN 5 1/8 09/16/24 EMTN	670	0	670	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0453133950	4.8750 % WMT 4 7/8 09/21/29	250	0	0	250 EUR	107.98%	269'952.50	0.04	a)
XS0525602339	4.1250 % RABOBK 4 1/8 07/14/25	930	0	0	930 EUR	100.65%	936'072.90	0.13	a)
XS0542534192	4.3750 % ATOSTR 4 3/8 09/16/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.54%	201'078.00	0.03	a)
XS0545428285	3.8750 % TELIAS 3 7/8 10/01/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	100.30%	250'760.00	0.03	a)
XS0758420748	3.5000 % HEIANA 3 1/2 03/19/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0787786440	3.0000 % BHP 3 05/29/24 8	220	0	220	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS0811555183	2.8750 % HEIANA 2 7/8 08/04/25 EMTN	350	0	0	350 EUR	98.83%	345'887.50	0.05	a)
XS0826189028	3.0000 % TELIAS 3 09/07/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.70%	197'404.00	0.03	a)
XS0834371469	3.5000 % OMVAV 3 1/2 09/27/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	100.32%	300'957.00	0.04	a)
XS0834385923	3.2500 % BHP 3 1/4 09/24/27 10	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0857662448	2.3750 % MCD 2 3/8 11/27/24 GMTN	0	100	0	100 EUR	98.99%	98'990.00	0.01	a)
XS0862442331	2.6250 % TELNO 2 5/8 12/06/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	99.11%	297'315.00	0.04	a)
XS0862952297	2.8750 % DHLGR 2 7/8 12/11/24 EMTN	350	0	0	350 EUR	99.48%	348'166.00	0.05	a)
XS0866310088	3.5500 % T 3.55 12/17/32	300	100	0	400 EUR	97.99%	391'976.00	0.05	a)
XS0875797515	3.2500 % DT 3 1/4 01/17/28 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0922885362	2.6250 % MSFT 2 5/8 05/02/33	200	0	0	200 EUR	97.35%	194'692.00	0.03	a)
XS0924998809	3.1250 % BHP 3 1/8 04/29/33 13	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0933241456	2.5000 % TELNO 2 1/2 05/22/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	98.43%	492'165.00	0.07	a)
XS0934539726	2.6250 % RBOSGR 2 5/8 05/24/28	200	0	0	200 EUR	97.25%	194'502.00	0.03	a)
XS0935427970	2.8750 % JPM 2 7/8 05/24/28 EMTN	0	400	0	400 EUR	97.23%	388'908.00	0.05	a)
XS0942082115	2.8750 % VGASDE 2 7/8 06/12/25 02	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS0968972199	3.5000 % TELIAS 3 1/2 09/05/33 EMTN	250	0	0	250 EUR	100.11%	250'285.00	0.03	a)
XS0969572204	2.8750 % EQNR 2 7/8 09/10/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.93%	197'860.00	0.03	a)
XS0970852348	3.7500 % ENIIM 3 3/4 09/12/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.05%	200'100.00	0.03	a)
XS0991099630	2.8750 % IBM 2 7/8 11/07/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.82%	296'460.00	0.04	a)
XS0993148856	3.5000 % T 3 1/2 12/17/25	320	0	0	320 EUR	99.51%	318'428.80	0.04	a)
XS0994991411	2.8750 % TTEFP 2 7/8 11/19/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.96%	197'912.00	0.03	a)
XS1001749289	3.1250 % MSFT 3 1/8 12/06/28	600	0	0	600 EUR	100.31%	601'854.00	0.08	a)
XS1023703090	3.6250 % ENIIM 3 5/8 01/29/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.34%	301'005.00	0.04	a)
XS1028421383	3.1250 % ACAFP 3 1/8 02/05/26 EMTN	0	400	0	400 EUR	99.12%	396'480.00	0.05	a)
XS1028599287	5.2500 % ORAFP 5 1/4 PERP	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1028941117	1.8750 % MRK 1 7/8 10/15/26	250	0	0	250 EUR	96.32%	240'790.00	0.03	a)
XS1028941893	2.5000 % MRK 2 1/2 10/15/34	250	0	0	250 EUR	94.32%	235'802.50	0.03	a)
XS1028950290	4.5000 % NNGRNV 4 1/2 PERP	300	0	0	300 EUR	99.81%	299'424.00	0.04	a)
XS1028952312	2.3750 % BXBAAU 2 3/8 06/12/24	120	0	120	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1028954870	3.0000 % ITW 3 05/19/34	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1030851791	2.6250 % EFPF 2 5/8 02/10/24 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1030900242	3.2500 % VZ 3 1/4 02/17/26 EMTN	0	400	0	400 EUR	99.69%	398'740.00	0.05	a)
XS1032529205	3.3750 % ATIM 3 3/8 02/13/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1034975406	3.0000 % JPM 3 02/19/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	99.30%	297'909.00	0.04	a)
XS1040506898	2.9720 % BPLN 2.972 02/27/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	99.23%	297'693.00	0.04	a)
XS1041772986	2.3750 % DSM 2 3/8 04/03/24 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1045553812	2.6250 % BFCM 2 5/8 03/18/24 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1048428442	4.6250 % VW 4 5/8 PERP	500	200	500	200 EUR	98.09%	196'174.00	0.03	a)
XS1048519679	2.5000 % TTEFP 2 1/2 03/25/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	98.23%	392'936.00	0.05	a)
XS1048529041	2.5000 % RDSALN 2 1/2 03/24/26 EMTN	550	0	0	550 EUR	98.20%	540'122.00	0.07	a)
XS1054522922	4.6250 % NNGRNV 4 5/8 04/08/44	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1054534422	2.5500 % WMT 2.55 04/08/26	300	0	0	300 EUR	98.55%	295'653.00	0.04	a)
XS1061711575	4.0000 % AEGON 4 04/25/44 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1061714165	2.6250 % PEP 2 5/8 04/28/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.27%	196'530.00	0.03	a)
XS1062493934	2.8750 % AON 2 7/8 05/14/26	320	0	0	320 EUR	97.24%	311'174.40	0.04	a)
XS1062900912	4.1250 % ASSGEN 4 1/8 05/04/26 EMTN	500	0	0	500 EUR	100.72%	503'585.00	0.07	a)
XS1068871448	2.3750 % BNP 2 3/8 05/20/24 EMTN	380	0	380	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1068874970	2.3750 % C 2 3/8 05/22/24 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1069439740	3.8750 % AXASA 3 7/8 PERP EMTN	350	0	0	350 EUR	99.13%	346'958.50	0.05	a)
XS1069539291	2.3750 % DGELN 2 3/8 05/20/26 EMTN	350	0	0	350 EUR	97.81%	342'342.00	0.05	a)
XS1069549761	3.0000 % BFCM 3 05/21/24 EMTN	280	0	280	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1071713470	2.5000 % CARLB 2 1/2 05/28/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1072516690	3.0000 % PLD 3 06/02/26	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1074055770	2.5000 % URWFP 2 1/2 06/04/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.67%	244'165.00	0.03	a)
XS1074144871	2.8750 % GS 2 7/8 06/03/26 EMTN	205	0	0	205 EUR	98.73%	202'386.25	0.03	a)
XS1074208270	2.5000 % ENBW 2 1/2 06/04/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.02%	294'045.00	0.04	a)
XS1074382893	2.1250 % WFC 2 1/8 06/04/24 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1075218799	2.2500 % BACR 2 1/4 06/10/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1076018131	2.4000 % T 2.4 03/15/24	360	0	360	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1076018305	3.3750 % T 3 3/8 03/15/34	250	0	0	250 EUR	95.80%	239'490.00	0.03	a)
XS1076781589	4.3750 % NNGRNV 4 3/8 PERP EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1077882394	2.7500 % ETISLT 2 3/4 06/18/26 GMTN	420	0	420	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1079726334	2.3750 % BAC 2 3/8 06/19/24 EMTN	450	0	450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1080163964	2.5000 % SWFP 2 1/2 06/24/26	200	0	0	200 EUR	98.17%	196'346.00	0.03	a)
XS1083986718	3.8750 % AVLN 3 7/8 07/03/44 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1084563615	1.7500 % RBOSGR 1 3/4 07/08/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	99.27%	198'548.00	0.03	a)
XS1087816374	2.2500 % SCGAU 2 1/4 07/16/24 EMTN	150	0	0	150 EUR	99.13%	148'701.00	0.02	a)
XS1088274672	3.0000 % FIREIT 3 07/16/24 EMTN	120	0	120	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1091654761	2.3750 % IDSLN 2 3/8 07/29/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1107727007	2.1250 % C 2 1/8 09/10/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.79%	290'358.00	0.04	a)
XS1109741329	2.5000 % CMCSA 2 1/2 09/15/26 EMTN	274	0	274	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1109744778	1.8750 % TCLAU 1 7/8 09/16/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.82%	296'463.00	0.04	a)
XS1109765005	3.9280 % ISPIM 3.928 09/15/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	99.66%	298'992.00	0.04	a)
XS1109802568	1.8750 % VOD 1 7/8 09/11/25 EMTN	450	0	0	450 EUR	97.71%	439'681.50	0.06	a)
XS1109950755	1.7500 % ZURNVX 1 3/4 09/16/24 EMTN	150	0	0	150 EUR	98.81%	148'213.50	0.02	a)
XS1111108673	2.2500 % HITTFP 2 1/4 03/24/25	300	0	0	300 EUR	98.41%	295'215.00	0.04	a)
XS1111559925	2.1250 % TTEFP 2 1/8 09/18/29 EMTN	500	0	0	500 EUR	93.26%	466'305.00	0.06	a)
XS1112013666	2.2500 % WPPLN 2 1/4 09/22/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	96.88%	242'195.00	0.03	a)
XS1112678989	1.8750 % KO 1 7/8 09/22/26	300	0	0	300 EUR	96.56%	289'677.00	0.04	a)
XS1112829947	1.7500 % DGELN 1 3/4 09/23/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.87%	197'740.00	0.03	a)
XS1114473579	2.2130 % BPLN 2.213 09/25/26 EMTN	230	0	0	230 EUR	97.20%	223'566.90	0.03	a)
XS1116263325	2.1250 % GS 2 1/8 09/30/24 EMTN	274	0	0	274 EUR	98.96%	271'155.88	0.04	a)
XS1116408235	1.8750 % IBESM 1 7/8 10/08/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.90%	197'794.00	0.03	a)
XS1117286580	4.3750 % DANPEN 4 3/8 09/29/45	200	0	0	200 EUR	99.69%	199'378.00	0.03	a)
XS1117297785	1.2500 % BLK 1 1/4 05/06/25	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1117298163	1.7500 % MCO 1 3/4 03/09/27	200	0	0	200 EUR	95.42%	190'848.00	0.03	a)
XS1120892507	2.9320 % TELEFO 2.932 10/17/29 EMTN	100	200	0	300 EUR	96.57%	289'704.00	0.04	a)
XS1134519120	1.7500 % AKZANA 1 3/4 11/07/24 EMTN	100	0	0	100 EUR	98.67%	98'668.00	0.01	a)
XS1134541306	3.9410 % AXASA 3.941 PERP EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1134729794	1.6250 % NOVNVX 1 5/8 11/09/26	100	0	0	100 EUR	96.36%	96'363.00	0.01	a)
XS1135277140	1.6250 % RDSALN 1 5/8 01/20/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	95.67%	382'684.00	0.05	a)
XS1135337498	1.6250 % AAPL 1 5/8 11/10/26	500	0	0	500 EUR	96.02%	480'080.00	0.07	a)
XS1136406342	1.5000 % MMM 1 1/2 11/09/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.60%	283'791.00	0.04	a)
XS1138360166	2.1250 % WBA 2 1/8 11/20/26	300	0	0	300 EUR	93.98%	281'946.00	0.04	a)
XS1139315581	1.3750 % TTEFP 1 3/8 03/19/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	97.67%	390'664.00	0.05	a)
XS1140054526	2.2500 % BGGRP 2 1/4 11/21/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	93.21%	233'027.50	0.03	a)
XS1140300663	1.5000 % VERAU 1 1/2 11/20/24	100	0	0	100 EUR	98.53%	98'533.00	0.01	a)
XS1140857316	3.1250 % STANLN 3 1/8 11/19/24 EMTN	120	0	0	120 EUR	99.28%	119'132.40	0.02	a)
XS1144088165	2.6000 % T 2.6 12/17/29	200	0	0	200 EUR	94.16%	188'310.00	0.03	a)
XS1145750037	2.3750 % URENCO 2 3/8 12/02/24 EMTN	180	0	0	180 EUR	98.92%	178'061.40	0.02	a)
XS1146286205	2.6250 % VZ 2 5/8 12/01/31	0	300	0	300 EUR	92.95%	278'844.00	0.04	a)
XS1147605791	1.3750 % GSK 1 3/8 12/02/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.27%	196'548.00	0.03	a)
XS1148073205	2.2500 % REPSM 2 1/4 12/10/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1152343668	3.3750 % MRKGR 3 3/8 12/12/2074	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1155697243	5.0500 % LAMON 5.05 PERP	0	300	0	300 EUR	100.81%	302'418.00	0.04	a)
XS1166201035	1.2500 % BFCM 1 1/4 01/14/25 EMTN	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1167204699	1.2500 % LLOYDS 1 1/4 01/13/25 EMTN	380	0	380	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1167667283	1.6250 % VW 1 5/8 01/16/30 EMTN	280	280	280	280 EUR	89.25%	249'905.60	0.03	a)
XS1168962063	1.0000 % BMW 1 01/21/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	97.79%	391'144.00	0.05	a)
XS1173792059	1.7500 % C 1 3/4 01/28/25	410	0	0	410 EUR	98.18%	402'546.20	0.06	a)
XS1174469137	1.5000 % JPM 1 1/2 01/27/25 EMTN	0	300	0	300 EUR	98.10%	294'297.00	0.04	a)
XS1176079843	1.9660 % ENELIM 1.966 01/27/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	98.47%	492'340.00	0.07	a)
XS1177459531	1.2500 % ENGSM 1 1/4 02/06/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.65%	195'308.00	0.03	a)
XS1179916017	1.2500 % CAFP 1 1/4 06/03/25 EMTN	210	0	0	210 EUR	97.13%	203'964.60	0.03	a)
XS1180130939	1.3750 % RABOBK 1 3/8 02/03/27 GMTN	500	0	0	500 EUR	94.50%	472'500.00	0.06	a)
XS1180256528	1.7500 % MS 1 3/4 01/30/25 GMTN	500	0	0	500 EUR	98.23%	491'130.00	0.07	a)
XS1180451657	1.5000 % ENIIM 1 1/2 02/02/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	96.09%	192'176.00	0.03	a)
XS1180651587	4.2500 % ACHMEA 4 1/4 PERP EMTN	300	0	0	300 EUR	99.09%	297'273.00	0.04	a)
XS1186176571	1.5000 % HTHROW 1 1/2 02/11/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.59%	175'182.00	0.02	a)
XS1189263400	1.1250 % NDAFH 1 1/8 02/12/25 EMTN	450	0	0	450 EUR	97.45%	438'507.00	0.06	a)
XS1189286286	2.5000 % RENEPL 2 1/2 02/12/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.58%	197'156.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1190624038	1.2500 % EQNR 1 1/4 02/17/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.07%	282'216.00	0.04	a)
XS1190624202	1.6250 % EQNR 1 5/8 02/17/35 EMTN	300	0	0	300 EUR	83.07%	249'219.00	0.03	a)
XS1190632999	2.3750 % BNP 2 3/8 02/17/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	98.40%	393'584.00	0.05	a)
XS1190974011	1.5730 % BPLN 1.573 02/16/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	94.64%	378'576.00	0.05	a)
XS1193213953	1.6250 % TELIAS 1 5/8 02/23/35 EMTN	0	200	0	200 EUR	82.82%	165'634.00	0.02	a)
XS1195056079	0.8750 % ROSW 0 7/8 02/25/25 EMTN	350	0	0	350 EUR	97.34%	340'697.00	0.05	a)
XS1195202822	2.6250 % TTEFP 2 5/8 PERP EMTN	750	0	0	750 EUR	97.75%	733'125.00	0.10	a)
XS1195574881	2.6250 % SOCGEN 2 5/8 02/27/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	98.48%	393'908.00	0.05	a)
XS1196380031	2.4500 % T 2.45 03/15/35	350	0	0	350 EUR	86.30%	302'064.00	0.04	a)
XS1196503137	1.8000 % BKNG 1.8 03/03/27	0	300	0	300 EUR	95.04%	285'123.00	0.04	a)
XS1196797614	1.2500 % NWIDE 1 1/4 03/03/25 EMTN	620	0	0	620 EUR	97.51%	604'568.20	0.08	a)
XS1197270819	1.6250 % MDLZ 1 5/8 03/08/27	0	300	0	300 EUR	94.75%	284'247.00	0.04	a)
XS1197775692	1.5000 % APTV 1 1/2 03/10/25	150	0	0	150 EUR	97.47%	146'202.00	0.02	a)
XS1197833053	1.1250 % KO 1 1/8 03/09/27	500	0	0	500 EUR	93.78%	468'875.00	0.06	a)
XS1197833137	1.6250 % KO 1 5/8 03/09/35	550	0	0	550 EUR	83.53%	459'426.00	0.06	a)
XS1199356954	1.2500 % K 1 1/4 03/10/25	250	0	0	250 EUR	97.35%	243'365.00	0.03	a)
XS1199954691	1.2500 % SYNNVX 1 1/4 09/10/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.26%	180'510.00	0.02	a)
XS1201001572	2.5000 % SANTAN 2 1/2 03/18/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	98.34%	393'348.00	0.05	a)
XS1203941775	1.5000 % MEOGR 1 1/2 03/19/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.10%	291'291.00	0.04	a)
XS1204154410	2.6250 % ACAFP 2 5/8 03/17/27	0	600	0	600 EUR	95.88%	575'292.00	0.08	a)
XS1205548164	1.6250 % WPPLN 1 5/8 03/23/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	88.30%	220'750.00	0.03	a)
XS1205616698	2.0000 % APAAU 2 03/22/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.78%	189'566.00	0.03	a)
XS1205618470	3.0000 % VATFAL 3 03/19/2077	300	0	0	300 EUR	95.15%	285'459.00	0.04	a)
XS1206411230	1.8750 % CCEP 1 7/8 03/18/30	370	0	0	370 EUR	90.60%	335'227.40	0.05	a)
XS1206541366	3.5000 % VW 3 1/2 PERP	450	150	450	150 EUR	87.96%	131'932.50	0.02	a)
XS1207005023	1.5000 % STATK 1 1/2 03/26/30 EMTN	150	200	0	350 EUR	89.48%	313'194.00	0.04	a)
XS1207058733	4.5000 % REPSM 4 1/2 03/25/2075	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1209031019	2.6000 % SRENVX 2.6 PERP	200	0	0	200 EUR	97.14%	194'270.00	0.03	a)
XS1209863254	1.3750 % BAC 1 3/8 03/26/25 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1215181980	1.0000 % DSM 1 04/09/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.33%	97'333.00	0.01	a)
XS1218319702	1.0000 % URWFP 1 03/14/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.94%	193'876.00	0.03	a)
XS1218363270	1.3750 % URWFP 1 3/8 04/15/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.82%	171'638.00	0.02	a)
XS1218821756	1.0000 % ABNANV 1 04/16/25 EMTN	540	0	0	540 EUR	97.20%	524'853.00	0.07	a)
XS1219462543	1.1250 % REESM 1 1/8 04/24/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.11%	194'214.00	0.03	a)
XS1222590488	2.0000 % EDPL 2 04/22/25 EMTN	270	0	0	270 EUR	98.19%	265'107.60	0.04	a)
XS1223842847	1.8750 % REDEXS 1 7/8 04/27/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	94.02%	188'042.00	0.03	a)
XS1224955408	1.5000 % BHP 1 1/2 04/29/30 17	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1226748439	1.0000 % BMY 1 05/15/25	200	0	0	200 EUR	96.95%	193'906.00	0.03	a)
XS1226748512	1.7500 % BMY 1 3/4 05/15/35	200	0	0	200 EUR	84.89%	169'776.00	0.02	a)
XS1231027464	1.3000 % RELLN 1.3 05/12/25	200	0	0	200 EUR	97.03%	194'060.00	0.03	a)
XS1234373733	1.7500 % MMM 1 3/4 05/15/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.53%	265'581.00	0.04	a)
XS1234953906	2.1250 % ITW 2 1/8 05/22/30	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1237271421	1.8750 % MCD 1 7/8 05/26/27 GMTN	0	200	0	200 EUR	95.05%	190'104.00	0.03	a)
XS1239502328	2.0000 % TCLAU 2 08/28/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.50%	97'503.00	0.01	a)
XS1239586594	2.1250 % ESBIRE 2 1/8 06/08/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	95.44%	238'600.00	0.03	a)
XS1240751062	1.6250 % LLY 1 5/8 06/02/26	200	0	0	200 EUR	96.43%	192'856.00	0.03	a)
XS1240751229	2.1250 % LLY 2 1/8 06/03/30	250	0	0	250 EUR	93.97%	234'930.00	0.03	a)
XS1241581096	1.7500 % TENN 1 3/4 06/04/27 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1242413679	3.3750 % AVLN 3 3/8 12/04/45 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.82%	244'540.00	0.03	a)
XS1245292807	4.3750 % SLHNVX 4 3/8 PERP	200	0	0	200 EUR	99.13%	198'250.00	0.03	a)
XS1246732249	3.6250 % LBBW 3 5/8 06/16/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.99%	191'976.00	0.03	a)
XS1254428896	3.0000 % HSBC 3 06/30/25 EMTN	500	750	0	1'250 EUR	98.48%	1'230'962.50	0.17	a)
XS1255433754	2.6250 % ECL 2 5/8 07/08/25	290	0	0	290 EUR	98.72%	286'285.10	0.04	a)
XS1288849471	2.3750 % KYGID 2 3/8 09/10/25	200	0	0	200 EUR	97.63%	195'264.00	0.03	a)
XS1288858548	3.0000 % BFCM 3 09/11/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.42%	196'832.00	0.03	a)
XS1288894691	1.7500 % SCMNFX 1 3/4 09/15/25	200	0	0	200 EUR	97.32%	194'634.00	0.03	a)
XS1292389415	2.0000 % AAPL 2 09/17/27	300	0	0	300 EUR	96.32%	288'960.00	0.04	a)
XS1292468045	1.8750 % RDSALN 1 7/8 09/15/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.46%	243'660.00	0.03	a)
XS1293505639	5.1250 % ASRNED 5 1/8 09/29/45	200	0	0	200 EUR	101.01%	202'018.00	0.03	a)
XS1294343337	6.2500 % OMVAV 6 1/4 PERP	200	0	0	200 EUR	103.00%	206'000.00	0.03	a)
XS1310934382	2.0000 % WFC 2 04/27/26 EMTN	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
X51311440082	5.5000 % ASSGEN 5 1/2 10/27/47 EMTN	400	0	0	400 EUR	103.48%	413'924.00	0.06	a)
X51316569638	1.8750 % ATOSTR 1 7/8 11/04/25 EMTN	130	0	0	130 EUR	96.60%	125'581.30	0.02	a)
X51319820541	1.6250 % FXD 1 5/8 01/11/27	400	0	0	400 EUR	94.53%	378'120.00	0.05	a)
X51321424670	2.2500 % CMCSA 2 1/4 11/17/25 GMTN	196	0	196	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51323463726	1.6250 % UPS 1 5/8 11/15/25	200	0	0	200 EUR	96.86%	193'720.00	0.03	a)
X51325645825	2.7500 % BNP 2 3/4 01/27/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.85%	195'690.00	0.03	a)
X51327028459	2.1000 % MA 2.1 12/01/27	300	0	0	300 EUR	95.64%	286'920.00	0.04	a)
X51327504087	1.7500 % ATOSTR 1 3/4 06/26/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.32%	190'646.00	0.03	a)
X51346115295	1.6250 % BFCM 1 5/8 01/19/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	96.33%	385'300.00	0.05	a)
X51346228577	3.3750 % AXASA 3 3/8 07/06/47 EMTN	400	100	0	500 EUR	96.92%	484'575.00	0.07	a)
X51362373224	3.0000 % GS 3 02/12/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.66%	289'965.00	0.04	a)
X51369250755	1.6250 % BNP 1 5/8 02/23/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.34%	289'005.00	0.04	a)
X51369278764	2.0000 % AMGN 2 02/25/26	0	300	0	300 EUR	97.08%	291'246.00	0.04	a)
X51372839214	2.2000 % VOD 2.2 08/25/26 EMTN	650	0	0	650 EUR	97.11%	631'221.50	0.09	a)
X51373131546	1.5000 % TEMASE 1 1/2 03/01/28 EMTN	0	150	0	150 EUR	92.60%	138'894.00	0.02	a)
X51375841233	1.1250 % IBM 1 1/8 09/06/24	200	0	0	200 EUR	98.66%	197'310.00	0.03	a)
X51375955678	1.7500 % IBM 1 3/4 03/07/28	200	0	0	200 EUR	93.94%	187'884.00	0.03	a)
X51375957294	1.9530 % BPLN 1.953 03/03/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51376614118	1.3750 % URWFP 1 3/8 03/09/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.54%	286'620.00	0.04	a)
X51377679961	1.7500 % BRITEL 1 3/4 03/10/26 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51377745937	1.7500 % COVEGR 1 3/4 09/25/24 DIP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51378880253	2.8750 % BNP 2 7/8 10/01/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.50%	194'990.00	0.03	a)
X51379122101	1.5000 % AMXLMM 1 1/2 03/10/24	450	0	450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51379122523	2.1250 % AMXLMM 2 1/8 03/10/28	0	200	0	200 EUR	94.50%	188'996.00	0.03	a)
X51379184473	2.5000 % HSBC 2 1/2 03/15/27 EMTN	350	0	0	350 EUR	96.63%	338'215.50	0.05	a)
X51382784509	1.2500 % RABOBK 1 1/4 03/23/26 GMTN	704	0	0	704 EUR	95.76%	674'143.36	0.09	a)
X51382791975	1.5000 % DT 1 1/2 04/03/28 EMTN	450	0	450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51384064587	3.2500 % SANTAN 3 1/4 04/04/26 DIP	300	100	0	400 EUR	98.29%	393'140.00	0.05	a)
X51384281090	1.3750 % RELLN 1 3/8 05/12/26	250	0	0	250 EUR	95.55%	238'880.00	0.03	a)
X51385945131	2.3750 % BFCM 2 3/8 03/24/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.68%	290'037.00	0.04	a)
X51388625425	3.7500 % STLA 3 3/4 03/29/24 GMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51391086987	2.0000 % CKHH 2 04/06/28 B	0	200	0	200 EUR	93.31%	186'624.00	0.03	a)
X51391625289	1.1250 % AKZANA 1 1/8 04/08/26 EMTN	0	150	0	150 EUR	95.33%	142'993.50	0.02	a)
X51392459381	1.5000 % UBS 1 1/2 04/10/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	95.29%	381'144.00	0.05	a)
X51394764689	1.4600 % TELEFO 1.46 04/13/26 EMTN	200	200	0	400 EUR	95.70%	382'796.00	0.05	a)
X51395010397	1.5000 % MNDILN 1 1/2 04/15/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51395021089	1.2500 % ACAFP 1 1/4 04/14/26 EMTN	0	700	0	700 EUR	95.18%	666'239.00	0.09	a)
X51395057430	1.1250 % TLSAU 1 1/8 04/14/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	95.09%	285'267.00	0.04	a)
X51395060491	1.0000 % REESM 1 04/21/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.15%	190'308.00	0.03	a)
X51395180802	2.6250 % DLR 2 5/8 04/15/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51396261338	0.7500 % BMW 0 3/4 04/15/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51396367911	0.8750 % ENEXIS 0 7/8 04/28/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.73%	284'196.00	0.04	a)
X51396767854	1.2500 % NTGYSM 1 1/4 04/19/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	95.10%	380'412.00	0.05	a)
X51397134609	1.0000 % LIN 1 04/20/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	91.89%	275'661.00	0.04	a)
X51398476793	1.1250 % IBESM 1 1/8 04/21/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	95.47%	381'880.00	0.05	a)
X51400169931	1.3750 % WFC 1 3/8 10/26/26 EMTN	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51401174633	1.0000 % HEIANA 1 05/04/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.81%	94'814.00	0.01	a)
X51401196958	1.1250 % URWFP 1 1/8 04/28/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.84%	185'688.00	0.03	a)
X51401197253	2.0000 % URWFP 2 04/28/36 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.39%	162'774.00	0.02	a)
X51401331753	0.7500 % CAFP 0 3/4 04/26/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51402177601	1.7500 % CHGRID 1 3/4 05/19/25 REGS	150	0	0	150 EUR	97.12%	145'678.50	0.02	a)
X51402921412	1.5000 % JPM 1 1/2 10/29/26 EMTN	0	400	0	400 EUR	94.92%	379'676.00	0.05	a)
X51403015156	1.1250 % UNANA 1 1/8 04/29/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.92%	183'844.00	0.03	a)
X51403264291	1.7500 % MCD 1 3/4 05/03/28 GMTN	0	300	0	300 EUR	93.16%	279'474.00	0.04	a)
X51403388694	1.3750 % ENGSM 1 3/8 05/05/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.76%	185'522.00	0.03	a)
X51403499848	2.7500 % LIBMUT 2 3/4 05/04/26 REGS	250	0	0	250 EUR	97.21%	243'030.00	0.03	a)
X51405762805	1.5000 % TKAAP 1 1/2 12/07/26	200	100	0	300 EUR	95.05%	285'144.00	0.04	a)
X51405765733	1.2500 % DOV 1 1/4 11/09/26	0	150	0	150 EUR	94.20%	141'306.00	0.02	a)
X51405766624	1.3750 % VZ 1 3/8 11/02/28	0	350	0	350 EUR	91.23%	319'305.00	0.04	a)
X51405766897	0.8750 % VZ 0 7/8 04/02/25	0	200	0	200 EUR	97.03%	194'060.00	0.03	a)
X51405767515	1.0000 % UPS 1 11/15/28	150	0	0	150 EUR	89.61%	134'409.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1405769487	0.8750 % PPG 0 7/8 11/03/25	0	250	0	250 EUR	95.52%	238'787.50	0.03	a)
XS1405775534	1.3750 % TMO 1 3/8 09/12/28	0	200	0	200 EUR	91.40%	182'796.00	0.03	a)
XS1405780617	1.8750 % RVTY 1 7/8 07/19/26	200	0	0	200 EUR	95.25%	190'504.00	0.03	a)
XS1405780963	1.3750 % ASML 1 3/8 07/07/26	300	0	0	300 EUR	95.52%	286'551.00	0.04	a)
XS1405784015	2.2500 % KHC 2 1/4 05/25/28	0	400	0	400 EUR	94.78%	379'132.00	0.05	a)
XS1405816312	1.8750 % ATDBCN 1 7/8 05/06/26	0	300	0	300 EUR	96.03%	288'084.00	0.04	a)
XS1408317433	1.0000 % ORAFP 1 05/12/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.86%	193'720.00	0.03	a)
XS1410417544	1.0000 % K 1 05/17/24	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1410426024	1.1250 % AXASA 1 1/8 05/15/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.15%	184'294.00	0.03	a)
XS1411401083	1.2500 % RDSALN 1 1/4 05/12/28 EMTN	520	0	0	520 EUR	91.70%	476'855.60	0.07	a)
XS1411404426	1.2500 % AZN 1 1/4 05/12/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	92.38%	230'940.00	0.03	a)
XS1411404855	0.7500 % AZN 0 3/4 05/12/24 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1411405662	0.7500 % RDSALN 0 3/4 05/12/24 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1411535799	0.6500 % JNJ 0.65 05/20/24	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1412266816	1.1500 % JNJ 1.15 11/20/28	150	0	0	150 EUR	91.83%	137'748.00	0.02	a)
XS1412266907	1.6500 % JNJ 1.65 05/20/35	600	0	0	600 EUR	86.65%	519'888.00	0.07	a)
XS1412417617	1.2500 % NAB 1 1/4 05/18/26 GMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1412711217	1.6250 % ENIIM 1 5/8 05/17/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	92.36%	277'086.00	0.04	a)
XS1415535340	1.1250 % CCEP 1 1/8 05/26/24	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1415535696	1.7500 % CCEP 1 3/4 05/26/28	150	0	0	150 EUR	93.19%	139'777.50	0.02	a)
XS1418788755	3.5000 % ZURNVX 3 1/2 10/01/46 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.95%	244'875.00	0.03	a)
XS1419646317	1.5000 % BNP 1 1/2 05/25/28 EMTN	650	0	0	650 EUR	93.01%	604'565.00	0.08	a)
XS1419674525	1.5540 % DAAFIN 1.554 06/07/28	100	0	0	100 EUR	92.37%	92'374.00	0.01	a)
XS1425966287	1.3750 % ENELIM 1 3/8 06/01/26	400	0	0	400 EUR	95.09%	380'376.00	0.05	a)
XS1426022536	1.5460 % SUMIBK 1.546 06/15/26	0	550	0	550 EUR	95.26%	523'913.50	0.07	a)
XS1428773763	5.0000 % ASSGEN 5 06/08/48 EMTN	250	0	0	250 EUR	102.53%	256'312.50	0.04	a)
XS1428782160	1.8750 % ESBIRE 1 7/8 06/14/31 EMTN	250	0	0	250 EUR	88.69%	221'730.00	0.03	a)
XS1428953407	3.1250 % HSBC 3 1/8 06/07/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.70%	290'091.00	0.04	a)
XS1432384409	1.8750 % TENN 1 7/8 06/13/36 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1432384664	1.0000 % TENN 1 06/13/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1435056426	1.8500 % SO 1.85 06/20/26	0	150	0	150 EUR	95.91%	143'869.50	0.02	a)
XS1435229460	3.6250 % PVH 3 5/8 07/15/24 REGS	100	0	0	100 EUR	99.85%	99'849.00	0.01	a)
XS1440976535	1.2500 % TAP 1 1/4 07/15/24	250	0	0	250 EUR	99.00%	247'502.50	0.03	a)
XS1443997819	0.7500 % TTEFP 0 3/4 07/12/28 EMTN	500	0	0	500 EUR	89.33%	446'655.00	0.06	a)
XS1446746189	0.8750 % PEP 0 7/8 07/18/28	200	0	0	200 EUR	90.54%	181'078.00	0.02	a)
XS1457608286	1.5000 % C 1 1/2 10/26/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	90.90%	272'697.00	0.04	a)
XS1458408561	1.6250 % GS 1 5/8 07/27/26 EMTN	608	0	0	608 EUR	95.45%	580'354.24	0.08	a)
XS1463043973	1.0000 % WFC 1 02/02/27 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1463101680	1.6000 % VOD 1.6 07/29/31 EMTN	350	0	0	350 EUR	87.52%	306'309.50	0.04	a)
XS1470601656	2.2500 % BNP 2 1/4 01/11/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	95.84%	239'600.00	0.03	a)
XS1471646965	1.1250 % EDPL 1 1/8 02/12/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1476654238	0.3750 % RDSALN 0 3/8 02/15/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	96.94%	242'350.00	0.03	a)
XS1476654584	0.7500 % RDSALN 0 3/4 08/15/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	89.33%	223'327.50	0.03	a)
XS1482736185	0.6250 % ATCOA 0 5/8 08/30/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.40%	186'794.00	0.03	a)
XS1485532896	0.6250 % KPN 0 5/8 04/09/25 GMTN	200	0	0	200 EUR	96.51%	193'018.00	0.03	a)
XS1485533431	1.1250 % KPN 1 1/8 09/11/28 GMTN	200	0	0	200 EUR	90.03%	180'068.00	0.02	a)
XS1485597329	0.8750 % HSBC 0 7/8 09/06/24	950	0	0	950 EUR	98.46%	935'398.50	0.13	a)
XS1485603747	1.6000 % APTV 1.6 09/15/28	170	0	0	170 EUR	91.01%	154'720.40	0.02	a)
XS1485643610	1.1000 % KO 1.1 09/02/36	200	0	0	200 EUR	76.31%	152'622.00	0.02	a)
XS1488494987	1.0000 % HEMSOF 1 09/09/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.06%	184'118.00	0.03	a)
XS1489391109	1.2500 % PRE 1 1/4 09/15/26	250	0	0	250 EUR	93.51%	233'782.50	0.03	a)
XS1490726590	0.3750 % IBESM 0 3/8 09/15/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	95.15%	95'153.00	0.01	a)
XS1492457665	2.2500 % VTRS 2 1/4 11/22/24	700	0	700	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1492580516	4.5000 % SLHNVX 4 1/2 PERP EMTN	250	0	0	250 EUR	99.54%	248'845.00	0.03	a)
XS1492685885	0.7500 % ETN 0 3/4 09/20/24	250	0	0	250 EUR	98.29%	245'725.00	0.03	a)
XS1492825481	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 09/20/28	400	500	0	900 EUR	89.35%	804'150.00	0.11	a)
XS1493320656	0.6250 % CDTFIN 0 5/8 09/22/24 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1493322355	0.6250 % ENIIM 0 5/8 09/19/24 EMTN	0	200	0	200 EUR	98.28%	196'568.00	0.03	a)
XS1495373505	0.7500 % DSM 0 3/4 09/28/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.62%	187'242.00	0.03	a)
XS1496758092	0.7500 % ANZ 0 3/4 09/29/26	500	100	0	600 EUR	93.08%	558'498.00	0.08	a)
XS1501166869	3.3690 % TTEFP 3.369 PERP EMTN	400	0	0	400 EUR	97.50%	390'000.00	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1501367921	1.0000 % LXSGR 1 10/07/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.53%	187'056.00	0.03	a)
XS1503131713	1.0000 % TRNIM 1 10/11/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	89.48%	223'692.50	0.03	a)
XS1505132602	0.7500 % SWFP 0 3/4 04/14/27	200	0	0	200 EUR	93.32%	186'632.00	0.03	a)
XS1505554771	1.9300 % TELEFO 1.93 10/17/31 EMTN	400	0	0	400 EUR	89.05%	356'180.00	0.05	a)
XS1505568136	1.2500 % TENN 1 1/4 10/24/33 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1505573482	0.8750 % SRGIM 0 7/8 10/25/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	93.36%	373'420.00	0.05	a)
XS1505896735	1.3750 % CRHID 1 3/8 10/18/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.07%	182'136.00	0.03	a)
XS1506398244	0.8750 % WSTP 0 7/8 04/17/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.89%	183'782.00	0.03	a)
XS1508450688	2.1250 % UC GIM 2 1/8 10/24/26 EMTN	270	0	0	270 EUR	96.17%	259'645.50	0.04	a)
XS1508831051	0.7500 % ENGSM 0 3/4 10/27/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.13%	186'260.00	0.03	a)
XS1508912646	1.0000 % ACEIM 1 10/24/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	93.35%	186'700.00	0.03	a)
XS1509006380	1.2500 % GS 1 1/4 05/01/25 EMTN	350	500	0	850 EUR	97.09%	825'290.50	0.11	a)
XS1511787589	1.3750 % MS 1 3/8 10/27/26 GMTN	500	0	0	500 EUR	94.39%	471'965.00	0.06	a)
XS1512677003	1.8750 % BFCM 1 7/8 11/04/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	94.79%	379'156.00	0.05	a)
XS1512827095	1.8750 % MRLSM 1 7/8 11/02/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	95.40%	286'188.00	0.04	a)
XS1513055555	0.5000 % MRK 0 1/2 11/02/24	200	0	0	200 EUR	97.88%	195'758.00	0.03	a)
XS1513062411	1.3750 % MRK 1 3/8 11/02/36	250	0	0	250 EUR	80.34%	200'842.50	0.03	a)
XS1514149159	1.2500 % WHR 1 1/4 11/02/26	200	0	0	200 EUR	93.44%	186'882.00	0.03	a)
XS1515222385	0.7500 % EQNR 0 3/4 11/09/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.12%	186'234.00	0.03	a)
XS1515222468	1.6250 % EQNR 1 5/8 11/09/36 EMTN	150	0	0	150 EUR	81.01%	121'515.00	0.02	a)
XS1520899532	1.3750 % ABBV 1 3/8 05/17/24	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1520907814	2.1250 % ABBV 2 1/8 11/17/28	400	0	0	400 EUR	94.40%	377'616.00	0.05	a)
XS1523192588	0.8750 % URWFP 0 7/8 02/21/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.01%	242'517.50	0.03	a)
XS1527192485	1.3750 % HEIANA 1 3/8 01/29/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.21%	188'426.00	0.03	a)
XS1527556192	1.6250 % ASML 1 5/8 05/28/27	320	0	0	320 EUR	94.92%	303'744.00	0.04	a)
XS1527758145	1.0000 % IBESM 1 03/07/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1528093799	1.7500 % ATOSTR 1 3/4 02/01/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.15%	188'304.00	0.03	a)
XS1529684695	1.3750 % BOGAEI 1 3/8 12/05/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.06%	94'060.00	0.01	a)
XS1531347661	1.9000 % BDX 1.9 12/15/26	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1532779748	2.4250 % ZBH 2.425 12/13/26	0	200	0	200 EUR	96.78%	193'556.00	0.03	a)
XS1538284230	1.8750 % ACAFP 1 7/8 12/20/26 EMTN	0	900	0	900 EUR	95.35%	858'123.00	0.12	a)
XS1548436473	0.7500 % BMW 0 3/4 07/12/24 EMTN	250	0	0	250 EUR	98.98%	247'455.00	0.03	a)
XS1548444816	3.1250 % SANTAN 3 1/8 01/19/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.66%	292'992.00	0.04	a)
XS1550134602	0.7500 % HNDA 0 3/4 01/17/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1550149204	1.0000 % ENELIM 1 09/16/24 EMTN	550	400	950	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1550951138	2.3180 % TELEFO 2.318 10/17/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.59%	189'170.00	0.03	a)
XS1550951211	1.5280 % TELEFO 1.528 01/17/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	98.15%	490'760.00	0.07	a)
XS1550988643	4.6250 % NNGRNV 4 5/8 01/13/48 EMTN	300	0	0	300 EUR	100.16%	300'483.00	0.04	a)
XS1551446880	1.3750 % NTGYSM 1 3/8 01/19/27 EMTN	500	0	0	500 EUR	93.92%	469'615.00	0.06	a)
XS1551917591	1.6250 % IGIM 1 5/8 01/19/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.62%	236'547.50	0.03	a)
XS1554373677	2.1250 % FREGR 2 1/8 02/01/27	200	0	0	200 EUR	95.47%	190'948.00	0.03	a)
XS1554373834	3.0000 % FREGR 3 01/30/32	250	0	0	250 EUR	92.80%	232'000.00	0.03	a)
XS1557095616	1.3750 % DT 1 3/8 01/30/27 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1560853670	1.7500 % ESBIRE 1 3/4 02/07/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.00%	183'992.00	0.03	a)
XS1560863802	1.3790 % BAC 1.379 02/07/25 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1562614831	3.5000 % BBVASM 3 1/2 02/10/27 GMTN	300	0	0	300 EUR	98.85%	296'550.00	0.04	a)
XS1564337993	1.8750 % MOLNLY 1 7/8 02/28/25	250	0	0	250 EUR	97.70%	244'242.50	0.03	a)
XS1564394796	2.5000 % INTNED 2 1/2 02/15/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1566101603	1.0000 % UNANA 1 02/14/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	93.83%	375'312.00	0.05	a)
XS1567174286	1.5000 % MCK 1 1/2 11/17/25	0	200	0	200 EUR	96.33%	192'652.00	0.03	a)
XS1569845404	1.5000 % URWFP 1 1/2 02/22/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.36%	184'710.00	0.03	a)
XS1570260460	2.0000 % SMINLN 2 02/23/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.70%	191'394.00	0.03	a)
XS1574158082	1.0000 % PFE 1 03/06/27	500	0	0	500 EUR	93.73%	468'645.00	0.06	a)
XS1574672397	0.5000 % KO 0 1/2 03/08/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1575444622	1.0000 % IBESM 1 03/07/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.19%	291'567.00	0.04	a)
XS1575992596	1.5000 % WKLNA 1 1/2 03/22/27	200	0	0	200 EUR	94.38%	188'766.00	0.03	a)
XS1577586321	1.0000 % SGOPF 1 03/17/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.24%	291'705.00	0.04	a)
XS1577950667	1.5000 % BXBAU 1 1/2 10/04/27	150	0	0	150 EUR	93.20%	139'800.00	0.02	a)
XS1577951129	1.3750 % GMGAU 1 3/8 09/27/25 REGS	100	100	100	100 EUR	95.82%	95'823.00	0.01	a)
XS1577951715	1.1510 % ASABRE 1.151 09/19/25	250	0	0	250 EUR	96.13%	240'325.00	0.03	a)
XS1577956789	1.3000 % YANTZE 1.3 06/21/24	150	0	0	150 EUR	99.06%	148'587.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1577962084	1.3000 % BAX 1.3 05/30/25	250	0	0	250 EUR	96.86%	242'160.00	0.03	a)
XS1578127778	1.4500 % TMO 1.45 03/16/27	0	200	0	200 EUR	94.31%	188'610.00	0.03	a)
XS1578212299	0.8750 % MOTOPG 0 7/8 03/14/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.12%	194'240.00	0.03	a)
XS1582205040	1.1250 % STATK 1 1/8 03/20/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.15%	97'145.00	0.01	a)
XS1584122177	1.1250 % ESSITY 1 1/8 03/27/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1584122763	1.6250 % ESSITY 1 5/8 03/30/27 EMTN	150	0	0	150 EUR	94.40%	141'592.50	0.02	a)
XS1585010074	1.1250 % NOVNVX 1 1/8 09/30/27	400	0	0	400 EUR	93.34%	373'352.00	0.05	a)
XS1586337872	1.7500 % LIBMUT 1 3/4 03/27/24 REGS	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1586555945	1.8750 % VW 1 7/8 03/30/27 10Y	600	700	600	700 EUR	94.52%	661'633.00	0.09	a)
XS1587893451	3.3750 % HELNSW 3 3/8 09/29/47	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1587911451	2.6250 % BFCM 2 5/8 03/31/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.95%	191'908.00	0.03	a)
XS1589806907	1.6250 % HEIGR 1 5/8 04/07/26 EMTN	240	0	0	240 EUR	95.92%	230'200.80	0.03	a)
XS1589881785	0.8750 % BMW 0 7/8 04/03/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.13%	194'264.00	0.03	a)
XS1590568132	1.1250 % NTGYSM 1 1/8 04/11/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1591694481	2.9950 % TENN 2.995 PERP	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1591781452	1.3750 % AMT 1 3/8 04/04/25	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1595704872	1.0000 % EOANGR 1 04/13/25 DIP	250	0	0	250 EUR	96.96%	242'400.00	0.03	a)
XS1602547264	1.7760 % BAC 1.776 05/04/27 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1603892149	1.8750 % MS 1 7/8 04/27/27 GMTN	650	0	0	650 EUR	94.86%	616'616.00	0.08	a)
XS1605365193	1.3750 % ACAFP 1 3/8 05/03/27 EMTN	0	900	0	900 EUR	93.46%	841'149.00	0.12	a)
XS1611855237	2.0200 % HEIANA 2.02 05/12/32 EMTN	150	0	0	150 EUR	89.20%	133'804.50	0.02	a)
XS1612543121	1.5000 % GE 1 1/2 05/17/29	0	300	0	300 EUR	90.48%	271'452.00	0.04	a)
XS1612543394	2.1250 % GE 2 1/8 05/17/37	0	300	0	300 EUR	86.00%	257'988.00	0.04	a)
XS1613121422	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 05/16/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1614198262	1.3750 % GS 1 3/8 05/15/24 EMTN	610	0	610	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1614416193	1.5000 % BNP 1 1/2 11/17/25 EMTN	350	400	0	750 EUR	96.23%	721'695.00	0.10	a)
XS1614722806	1.1250 % CABKSM 1 1/8 05/17/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1615079974	1.6380 % JPM 1.638 05/18/28 EMTN	0	600	0	600 EUR	93.60%	561'594.00	0.08	a)
XS1616411119	1.6250 % EOANGR 1 5/8 05/22/29 EMTN	350	0	0	350 EUR	91.57%	320'502.00	0.04	a)
XS1617830721	1.5000 % WFC 1 1/2 05/24/27 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1617831026	1.2500 % BFCM 1 1/4 05/26/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	92.91%	371'632.00	0.05	a)
XS1617845083	0.9500 % IBM 0.95 05/23/25	450	0	0	450 EUR	96.74%	435'334.50	0.06	a)
XS1617845679	1.5000 % IBM 1 1/2 05/23/29	300	0	0	300 EUR	90.77%	272'304.00	0.04	a)
XS1617898363	1.1250 % DT 1 1/8 05/22/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1619312173	0.8750 % AAPL 0 7/8 05/24/25	700	0	0	700 EUR	96.82%	677'733.00	0.09	a)
XS1619312686	1.3750 % AAPL 1 3/8 05/24/29	450	0	0	450 EUR	91.87%	413'433.00	0.06	a)
XS1619568303	1.5000 % URWFP 1 1/2 05/29/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.11%	178'224.00	0.02	a)
XS1619643015	1.7500 % MRLSM 1 3/4 05/26/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.19%	97'192.00	0.01	a)
XS1620780202	2.7060 % CLEF 2.706 06/30/50 A8	200	0	0	200 EUR	92.57%	185'134.00	0.03	a)
XS1621087516	1.4130 % SUMIBK 1.413 06/14/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.90%	185'794.00	0.03	a)
XS1621351045	1.3750 % EXPNLN 1 3/8 06/25/26 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1622421722	1.7500 % AKFAST 1 3/4 02/07/25 EMTN	200	200	200	200 EUR	97.19%	194'374.00	0.03	a)
XS1623355457	1.6250 % NNGRNV 1 5/8 06/01/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.53%	189'050.00	0.03	a)
XS1623616783	2.2500 % GSWITC 2 1/4 05/31/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.20%	190'396.00	0.03	a)
XS1627193359	1.3750 % SGOPF 1 3/8 06/14/27 EMTN	600	0	0	600 EUR	93.40%	560'412.00	0.08	a)
XS1628004779	1.5000 % VVOYHT 1 1/2 06/19/24	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1629387462	1.5000 % HEIGR 1 1/2 06/14/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.37%	283'113.00	0.04	a)
XS1629774230	3.8750 % VW 3 7/8 PERP	600	600	600	600 EUR	94.23%	565'404.00	0.08	a)
XS1629866432	3.1500 % T 3.15 09/04/36	750	0	0	750 EUR	91.00%	682'507.50	0.09	a)
XS1632897762	0.7500 % TENN 0 3/4 06/26/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1632897929	1.3750 % TENN 1 3/8 06/26/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1637093508	0.6250 % CPGLN 0 5/8 07/03/24 EMTN	400	0	0	400 EUR	98.92%	395'676.00	0.05	a)
XS1637162592	1.2000 % DHR 1.2 06/30/27	0	200	0	200 EUR	93.13%	186'258.00	0.03	a)
XS1637277572	1.0000 % BNP 1 06/27/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1637333748	1.5000 % BRITEL 1 1/2 06/23/27 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1637863546	1.6370 % BPLN 1.637 06/26/29 EMTN	150	0	0	150 EUR	90.78%	136'170.00	0.02	a)
XS1641623381	1.8750 % HTHROW 1 7/8 07/12/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	85.75%	257'250.00	0.04	a)
XS1642590480	1.3750 % VW 1 3/8 01/20/25 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1645494375	1.0000 % NGGLN 1 07/12/24 EMTN	400	0	0	400 EUR	98.96%	395'824.00	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
X51648298559	0.8750 % NESNVX 0 7/8 07/18/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	96.45%	241'120.00	0.03	a)
X51651071877	1.4000 % TMO 1.4 01/23/26	0	400	0	400 EUR	95.96%	383'840.00	0.05	a)
X51651071950	1.9500 % TMO 1.95 07/24/29	0	200	0	200 EUR	92.50%	184'996.00	0.03	a)
X51651072099	2.8750 % TMO 2 7/8 07/24/37	0	200	0	200 EUR	92.17%	184'340.00	0.03	a)
X51651453729	2.0000 % NWDIE 2 07/25/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51652512457	1.3750 % SMDSLN 1 3/8 07/26/24 EMT7	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51652855815	1.5000 % VOD 1 1/2 07/24/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	94.13%	94'126.00	0.01	a)
X51652866002	1.3750 % TRNIM 1 3/8 07/26/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	93.04%	232'605.00	0.03	a)
X51654192191	0.8750 % UNANA 0 7/8 07/31/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.52%	193'044.00	0.03	a)
X51654192274	1.3750 % UNANA 1 3/8 07/31/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	90.88%	227'187.50	0.03	a)
X51654229373	1.3750 % GYCGR 1 3/8 08/03/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	91.58%	183'166.00	0.03	a)
X51672151492	1.7500 % HOLNSW 1 3/4 08/29/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	90.17%	270'498.00	0.04	a)
X51673102734	1.5000 % ISSDC 1 1/2 08/31/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.28%	184'562.00	0.03	a)
X51676933853	1.1250 % WSTP 1 1/8 09/05/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.08%	276'234.00	0.04	a)
X51676952481	0.8750 % SSELN 0 7/8 09/06/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	95.92%	479'580.00	0.07	a)
X51677912393	1.8750 % BALDER 1 7/8 01/23/26	0	200	0	200 EUR	93.92%	187'848.00	0.03	a)
X51678966935	1.7500 % CNHI 1 3/4 09/12/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.19%	194'386.00	0.03	a)
X51679515038	0.6250 % KMB 0 5/8 09/07/24	200	0	0	200 EUR	98.39%	196'776.00	0.03	a)
X51681050610	1.5000 % LLOYDS 1 1/2 09/12/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	93.24%	372'976.00	0.05	a)
X51681519184	1.0000 % GSK 1 09/12/26	150	0	0	150 EUR	94.23%	141'345.00	0.02	a)
X51681520356	1.3750 % GSK 1 3/8 09/12/29	250	0	0	250 EUR	90.31%	225'785.00	0.03	a)
X51681521081	1.7150 % TELEFO 1.715 01/12/28 EMTN	500	0	0	500 EUR	93.43%	467'130.00	0.06	a)
X51682538183	1.2500 % IBESM 1 1/4 09/13/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.77%	187'534.00	0.03	a)
X51685481332	0.6250 % NAB 0 5/8 09/18/24 GMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51685542497	1.6250 % IGIM 1 5/8 01/18/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	91.62%	274'845.00	0.04	a)
X51685653211	1.7500 % LSELN 1 3/4 09/19/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.09%	182'188.00	0.03	a)
X51685653302	0.8750 % LSELN 0 7/8 09/19/24 EMTN	150	0	0	150 EUR	98.36%	147'544.50	0.02	a)
X51685798370	0.8750 % ADNA 0 7/8 09/19/24	200	0	0	200 EUR	98.44%	196'882.00	0.03	a)
X51686846061	1.6250 % AALLN 1 5/8 09/18/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.53%	193'058.00	0.03	a)
X51688199949	1.8750 % ATOSTR 1 7/8 09/26/29 EMTN	180	0	0	180 EUR	89.01%	160'221.60	0.02	a)
X51689185426	1.5000 % MGCN 1 1/2 09/25/27	250	0	0	250 EUR	93.62%	234'052.50	0.03	a)
X51689523840	1.1250 % BNRGR 1 1/8 09/27/25	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51689535000	1.1250 % NDAFH 1 1/8 09/27/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	93.24%	233'090.00	0.03	a)
X51689540935	1.6250 % INTNED 1 5/8 09/26/29 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51691349952	2.0650 % NATUEN 2.065 09/28/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.41%	186'822.00	0.03	a)
X51691781865	1.5000 % HEIANA 1 1/2 10/03/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.58%	181'156.00	0.02	a)
X51692332684	1.9360 % CBAAU 1.936 10/03/29 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51692347526	1.1250 % VW 1 1/8 04/04/24 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51693281617	1.6250 % STANLN 1 5/8 10/03/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.11%	188'218.00	0.03	a)
X51693818525	1.3750 % TTEFP 1 3/8 10/04/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.54%	268'608.00	0.04	a)
X51700721464	1.3750 % SRGIM 1 3/8 10/25/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.06%	93'057.00	0.01	a)
X51704789590	1.5000 % IREIM 1 1/2 10/24/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	93.28%	186'566.00	0.03	a)
X51705553250	0.8750 % STEDIN 0 7/8 10/24/25 EMTN	150	0	0	150 EUR	95.81%	143'721.00	0.02	a)
X51706111793	1.3420 % MS 1.342 10/23/26 EMTN	350	0	0	350 EUR	96.01%	336'028.00	0.05	a)
X51707074941	0.3750 % NESNVX 0 3/8 01/18/24 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51707075245	1.7500 % NESNVX 1 3/4 11/02/37 EMTN	250	0	0	250 EUR	82.27%	205'662.50	0.03	a)
X51707075328	1.2500 % NESNVX 1 1/4 11/02/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	89.77%	224'415.00	0.03	a)
X51708161291	1.3750 % VZ 1 3/8 10/27/26	0	400	0	400 EUR	94.93%	379'704.00	0.05	a)
X51708167652	1.8750 % VZ 1 7/8 10/26/29 12Y	0	300	0	300 EUR	91.44%	274'314.00	0.04	a)
X51708192684	0.5000 % PG 0 1/2 10/25/24	200	0	0	200 EUR	97.94%	195'872.00	0.03	a)
X51708193815	1.2500 % PG 1 1/4 10/25/29	200	0	0	200 EUR	90.17%	180'342.00	0.02	a)
X51708335978	2.8750 % VZ 2 7/8 01/15/38 20Y	0	500	0	500 EUR	88.12%	440'610.00	0.06	a)
X51709374497	1.6080 % FIREIT 1.608 10/31/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	93.30%	233'257.50	0.03	a)
X51713463559	3.3750 % ENELIM 3 3/8 PERP 635	200	0	0	200 EUR	96.29%	192'588.00	0.03	a)
X51716616179	1.1000 % WHR 1.1 11/09/27	100	100	0	200 EUR	90.67%	181'346.00	0.02	a)
X51717355561	1.6250 % BFCM 1 5/8 11/15/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.93%	183'858.00	0.03	a)
X51717433541	1.1250 % AKFAST 1 1/8 03/14/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X51717441726	1.5000 % UPS 1 1/2 11/15/32	200	0	0	200 EUR	84.56%	169'122.00	0.02	a)
X51718316281	1.3750 % SOCGEN 1 3/8 01/13/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.92%	183'838.00	0.03	a)
X51718393439	0.8750 % NTGYSM 0 7/8 05/15/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.64%	193'282.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1718417717	1.6250 % BASGR 1 5/8 11/15/37 DIP	300	0	0	300 EUR	77.64%	232'920.00	0.03	a)
XS1718418103	0.8750 % BASGR 0 7/8 11/15/27 DIP	300	0	0	300 EUR	92.22%	276'657.00	0.04	a)
XS1720192696	2.2500 % ORSTED 2 1/4 11/24/3017	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1720642138	0.6250 % TOYOTA 0 5/8 11/21/24 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.80%	195'596.00	0.03	a)
XS1720761490	1.5000 % SEGPLP 1 1/2 11/20/25	0	150	0	150 EUR	95.76%	143'634.00	0.02	a)
XS1720922175	1.0000 % BRITEL 1 11/21/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1721051495	1.5000 % EDPLP 1 1/2 11/22/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.12%	186'236.00	0.03	a)
XS1721422068	1.8750 % VOD 1 7/8 11/20/29 EMTN	500	0	0	500 EUR	91.54%	457'695.00	0.06	a)
XS1721422902	2.8750 % VOD 2 7/8 11/20/37 EMTN	250	0	0	250 EUR	90.16%	225'402.50	0.03	a)
XS1721423462	1.1250 % VOD 1 1/8 11/20/25 EMTN	250	100	0	350 EUR	95.97%	335'888.00	0.05	a)
XS1721760541	1.5000 % ORSTED 1 1/2 11/26/29	300	0	0	300 EUR	88.93%	266'775.00	0.04	a)
XS1722801708	1.5000 % BNP 1 1/2 05/23/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	92.20%	230'495.00	0.03	a)
XS1722898431	1.7500 % NEPSJ 1 3/4 11/23/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.75%	195'492.00	0.03	a)
XS1724873275	1.0000 % SZUGR 1 11/28/25	200	0	0	200 EUR	94.92%	189'840.00	0.03	a)
XS1725677543	1.6250 % COLSM 1 5/8 11/28/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.13%	192'264.00	0.03	a)
XS1726152108	1.6210 % IBESM 1.621 11/29/29	200	0	0	200 EUR	92.35%	184'704.00	0.03	a)
XS1729879822	1.3750 % CASHSM 1 3/8 02/04/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1729882024	2.2500 % TALANX 2 1/4 12/05/47 GDIP	200	200	200	200 EUR	92.04%	184'072.00	0.03	a)
XS1730885073	1.3750 % INTNED 1 3/8 01/11/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.49%	277'467.00	0.04	a)
XS1733289406	4.2500 % CASSIM 4 1/4 12/14/47	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1734066811	3.1250 % PVH 3 1/8 12/15/27 REGS	200	0	0	200 EUR	97.18%	194'360.00	0.03	a)
XS1734533372	1.0000 % DHLGR 1 12/13/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.95%	183'894.00	0.03	a)
XS1734548644	1.2500 % VW 1 1/4 12/15/25 EMTN	200	200	200	200 EUR	95.80%	191'590.00	0.03	a)
XS1734689620	1.0000 % OMVAV 1 12/14/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	93.91%	234'780.00	0.03	a)
XS1747444831	1.1250 % BMW 1 1/8 01/10/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.16%	184'312.00	0.03	a)
XS1748456974	1.1250 % BNP 1 1/8 06/11/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.35%	235'872.50	0.03	a)
XS1750122225	0.7500 % BFCM 0 3/4 07/17/25 EMTN	400	400	0	800 EUR	96.05%	768'384.00	0.11	a)
XS1750349190	1.1250 % CBAAU 1 1/8 01/18/28	200	0	0	200 EUR	92.02%	184'032.00	0.03	a)
XS1750986744	1.1250 % ENELIM 1 1/8 09/16/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.15%	235'365.00	0.03	a)
XS1751004232	1.1250 % SANTAN 1 1/8 01/17/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	97.67%	488'365.00	0.07	a)
XS1755428502	1.5000 % NTGYSM 1 1/2 01/29/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.70%	278'088.00	0.04	a)
XS1756296965	1.4470 % TELEFO 1.447 01/22/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.24%	282'723.00	0.04	a)
XS1757377400	1.6250 % ALLRNV 1 5/8 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1757394322	1.3750 % BACR 1 3/8 01/24/26 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1765875718	1.6250 % ATIM 1 5/8 02/08/28 EMTN	0	150	0	150 EUR	91.90%	137'845.50	0.02	a)
XS1767087866	1.5000 % ACEIM 1 1/2 06/08/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	93.80%	281'403.00	0.04	a)
XS1767931121	2.1250 % SANTAN 2 1/8 02/08/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	93.12%	372'488.00	0.05	a)
XS1769041192	1.3750 % NOVNVX 1 3/8 08/14/30	200	0	0	200 EUR	89.30%	178'602.00	0.02	a)
XS1769041606	1.7000 % NOVNVX 1.7 08/14/38	250	0	0	250 EUR	82.54%	206'360.00	0.03	a)
XS1769090991	1.1250 % UNANA 1 1/8 02/12/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	94.12%	282'351.00	0.04	a)
XS1769091296	1.6250 % UNANA 1 5/8 02/12/33 EMTN	350	0	0	350 EUR	86.83%	303'919.00	0.04	a)
XS1771723167	1.6250 % MCK 1 5/8 10/30/26	0	200	0	200 EUR	94.84%	189'682.00	0.03	a)
XS1771838494	1.1250 % INTNED 1 1/8 02/14/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.56%	292'689.00	0.04	a)
XS1785340172	1.7500 % ISPIIM 1 3/4 03/20/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	92.68%	370'736.00	0.05	a)
XS1787477543	1.1250 % ADNA 1 1/8 03/19/26	200	0	0	200 EUR	95.31%	190'620.00	0.03	a)
XS1788515606	1.7500 % NWG 1 3/4 03/02/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	97.75%	391'008.00	0.05	a)
XS1788834700	1.5000 % NWISE 1 1/2 03/08/26	300	0	0	300 EUR	97.47%	292'422.00	0.04	a)
XS1789699607	1.7500 % MAERSK 1 3/4 03/16/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	96.00%	239'990.00	0.03	a)
XS1789751531	1.0000 % CFRVX 1 03/26/26	450	0	0	450 EUR	95.08%	427'855.50	0.06	a)
XS1789752182	1.5000 % CFRVX 1 1/2 03/26/30	300	0	0	300 EUR	90.09%	270'267.00	0.04	a)
XS1789759195	2.0000 % CFRVX 2 03/26/38	300	100	0	400 EUR	83.76%	335'044.00	0.05	a)
XS1790990474	1.3750 % ACAFP 1 3/8 03/13/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.54%	195'074.00	0.03	a)
XS1792505866	1.6940 % GM 1.694 03/26/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.61%	292'818.00	0.04	a)
XS1793252419	1.2500 % BNP 1 1/4 03/19/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.46%	243'645.00	0.03	a)
XS1793349926	1.1250 % SGOPF 1 1/8 03/23/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.10%	285'288.00	0.04	a)
XS1795252672	1.6250 % C 1 5/8 03/21/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.51%	277'530.00	0.04	a)
XS1796079488	2.0000 % INTNED 2 03/22/30	300	0	0	300 EUR	97.36%	292'071.00	0.04	a)
XS1796208632	1.6250 % SESGFP 1 5/8 03/22/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.41%	190'818.00	0.03	a)
XS1796209010	2.0000 % GS 2 03/22/28 EMTN	263	0	0	263 EUR	93.68%	246'375.77	0.03	a)
XS1799545329	1.8750 % ACSSCE 1 7/8 04/20/26	0	200	0	200 EUR	95.64%	191'288.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1799611642	3.2500 % AXASA 3 1/4 05/28/49 EMTN	600	0	0	600 EUR	94.27%	565'614.00	0.08	a)
XS1799938995	3.3750 % VW 3 3/8 PERP NC6	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1799939027	4.6250 % VW 4 5/8 PERP	400	200	400	200 EUR	96.09%	192'176.00	0.03	a)
XS1799975922	3.0000 % GWILN 3 03/29/25 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1801129286	2.1250 % VTRS 2 1/8 05/23/25	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1801905628	1.5980 % MIZUHO 1.598 04/10/28 EMTN	0	150	0	150 EUR	92.77%	139'150.50	0.02	a)
XS1803247557	1.1250 % SCMNIX 1 1/8 10/12/26	200	0	0	200 EUR	94.18%	188'354.00	0.03	a)
XS1806130305	2.0000 % CKHH 2 04/13/30	0	100	0	100 EUR	89.13%	89'133.00	0.01	a)
XS1806368897	1.7500 % SCGAU 1 3/4 04/11/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.11%	184'222.00	0.03	a)
XS1808338542	1.0000 % BNP 1 04/17/24 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1808351214	2.2500 % CABKSM 2 1/4 04/17/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.22%	291'669.00	0.04	a)
XS1808395930	2.0000 % COLSM 2 04/17/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.15%	192'294.00	0.03	a)
XS1808482746	1.1250 % HANRUE 1 1/8 04/18/28	300	0	0	300 EUR	93.95%	281'853.00	0.04	a)
XS1808739459	0.8750 % ABNANV 0 7/8 04/22/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.89%	290'667.00	0.04	a)
XS1810653540	1.7500 % HEIGR 1 3/4 04/24/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.96%	187'928.00	0.03	a)
XS1811024543	1.6590 % ENAPHO 1.659 04/26/24	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1811435251	1.6620 % BAC 1.662 04/25/28 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1812905526	1.2500 % AUSGF 1 1/4 07/30/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.47%	192'934.00	0.03	a)
XS1813593313	1.6250 % MNDILN 1 5/8 04/27/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.54%	191'070.00	0.03	a)
XS1815116998	1.3750 % PHIANA 1 3/8 05/02/28	150	0	0	150 EUR	90.80%	136'195.50	0.02	a)
XS1820037270	1.3750 % BBVASM 1 3/8 05/14/25 GMTN	200	0	0	200 EUR	97.03%	194'050.00	0.03	a)
XS1821883102	3.6250 % NFLX 3 5/8 05/15/27	0	400	0	400 EUR	99.99%	399'952.00	0.05	a)
XS1822828122	1.2500 % GSK 1 1/4 05/21/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.33%	190'654.00	0.03	a)
XS1822829799	1.7500 % GSK 1 3/4 05/21/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	90.97%	227'422.50	0.03	a)
XS1823246803	1.1250 % BMW 1 1/8 05/22/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.48%	286'428.00	0.04	a)
XS1823300949	1.9500 % AMT 1.95 05/22/26	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1823485039	1.0000 % OPBANK 1 05/22/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1823502577	1.5000 % BASGR 1 1/2 05/22/30 12Y	150	0	0	150 EUR	90.08%	135'126.00	0.02	a)
XS1823502650	0.8750 % BASGR 0 7/8 05/22/25 7Y	150	0	0	150 EUR	96.86%	145'290.00	0.02	a)
XS1823518730	1.0000 % WURTH 1 05/26/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1823623878	1.8750 % CNHI 1 7/8 01/19/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	96.64%	144'966.00	0.02	a)
XS1824240136	2.5000 % BFCM 2 1/2 05/25/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.37%	188'740.00	0.03	a)
XS1828032786	1.3750 % DT 1 3/8 12/01/25 EMTN	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1828033834	2.0000 % DT 2 12/01/29 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1828037827	2.0000 % TENN 2 06/05/34 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1830986326	1.2500 % VW 1 1/4 06/10/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1835955474	1.8120 % JPM 1.812 06/12/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	92.30%	276'897.00	0.04	a)
XS1837288494	1.1250 % KNOGR 1 1/8 06/13/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	96.81%	242'027.50	0.03	a)
XS1839680680	1.7500 % MAN 1 3/4 06/22/26	200	0	0	200 EUR	95.66%	191'326.00	0.03	a)
XS1840618059	1.5000 % BAYNGR 1 1/2 06/26/26	600	0	0	600 EUR	94.08%	564'498.00	0.08	a)
XS1840618216	2.1250 % BAYNGR 2 1/8 12/15/29	500	0	0	500 EUR	88.56%	442'815.00	0.06	a)
XS1843434793	1.0000 % ITW 1 06/05/31	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1843435170	0.6250 % ITW 0 5/8 12/05/27	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1843435253	0.2500 % ITW 0 1/4 12/05/24	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1843435923	2.0000 % FIS 2 05/21/30	0	300	0	300 EUR	90.53%	271'584.00	0.04	a)
XS1843436145	2.9500 % FIS 2.95 05/21/39	0	150	0	150 EUR	90.49%	135'736.50	0.02	a)
XS1843436228	1.5000 % FIS 1 1/2 05/21/27	0	400	0	400 EUR	93.27%	373'088.00	0.05	a)
XS1843442622	1.7500 % NDAQ 1 3/4 03/28/29	250	0	0	250 EUR	91.02%	227'542.50	0.03	a)
XS1843443190	2.2000 % MO 2.2 06/15/27	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1843443513	1.7000 % MO 1.7 06/15/25	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1843443786	3.1250 % MO 3 1/8 06/15/31	470	0	470	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1843448314	3.2500 % MUNRE 3 1/4 05/26/49	400	0	0	400 EUR	94.89%	379'556.00	0.05	a)
XS1843449122	2.2500 % TACHEM 2 1/4 11/21/26 REGS	411	0	0	411 EUR	96.41%	396'228.66	0.05	a)
XS1843449395	3.0000 % TACHEM 3 11/21/30 REGS	411	100	0	511 EUR	95.78%	489'451.13	0.07	a)
XS1843459436	2.0000 % APH 2 10/08/28	200	0	0	200 EUR	94.83%	189'656.00	0.03	a)
XS1843459782	1.8000 % IFF 1.8 09/25/26	250	0	0	250 EUR	94.45%	236'132.50	0.03	a)
XS1846632104	1.6250 % EDPL 1 5/8 01/26/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	96.67%	145'003.50	0.02	a)
XS1847692636	1.2500 % IBESM 1 1/4 10/28/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.00%	189'992.00	0.03	a)
XS1849518276	2.8750 % SKGID 2 7/8 01/15/26	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1849550592	2.2500 % AIB 2 1/4 07/03/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.08%	196'166.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1851278777	1.5940 % BPLN 1.594 07/03/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.39%	184'776.00	0.03	a)
XS1854166078	2.0000 % VESTNL 2 07/10/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	95.38%	143'062.50	0.02	a)
XS1854532949	1.5000 % FMEGR 1 1/2 07/11/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	96.85%	193'698.00	0.03	a)
XS1856797219	1.4500 % WSTP 1.45 07/17/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	91.68%	229'195.00	0.03	a)
XS1856834608	1.3750 % BFCM 1 3/8 07/16/28 EMTN	500	0	0	500 EUR	91.50%	457'510.00	0.06	a)
XS1859010685	1.5000 % C 1 1/2 07/24/26 EMTN	550	0	0	550 EUR	96.76%	532'158.00	0.07	a)
XS1861206636	2.0000 % GS 2 11/01/28 EMTN	411	0	0	411 EUR	92.96%	382'061.49	0.05	a)
XS1861322383	1.8750 % PLD 1 7/8 01/05/29	450	0	450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1865186677	1.6250 % VW 1 5/8 08/15/25 EMTN	300	300	300	300 EUR	96.97%	290'922.00	0.04	a)
XS1867412006	2.0000 % CHGDNU 2 09/11/25	200	0	0	200 EUR	96.12%	192'232.00	0.03	a)
XS1872032799	1.3750 % NAB 1 3/8 08/30/28 GMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1873143645	1.0000 % BMW 1 08/29/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.54%	289'623.00	0.04	a)
XS1873208950	0.5000 % UNANA 0 1/2 01/06/25 6Y	250	0	0	250 EUR	97.38%	243'455.00	0.03	a)
XS1873209172	1.3750 % UNANA 1 3/8 09/04/30	150	0	0	150 EUR	89.11%	133'660.50	0.02	a)
XS1874122267	1.4910 % TTEFP 1.491 09/04/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.66%	177'328.00	0.02	a)
XS1874122770	1.0230 % TTEFP 1.023 03/04/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.27%	186'536.00	0.03	a)
XS1874127902	1.3750 % SIEGR 1 3/8 09/06/30 EMTN	330	0	0	330 EUR	89.11%	294'046.50	0.04	a)
XS1874128033	1.0000 % SIEGR 1 09/06/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.22%	279'660.00	0.04	a)
XS1875275205	2.0000 % NWG 2 03/04/25 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1875284702	1.3750 % SSELN 1 3/8 09/04/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.00%	279'003.00	0.04	a)
XS1875331636	1.1250 % GIVNVX 1 1/8 09/17/25 EUR	300	0	0	300 EUR	96.24%	288'711.00	0.04	a)
XS1876076040	1.6250 % SABSMM 1 5/8 03/07/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1877595014	1.7500 % HEIANA 1 3/4 03/17/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.05%	267'147.00	0.04	a)
XS1877595444	1.2500 % HEIANA 1 1/4 03/17/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.79%	187'582.00	0.03	a)
XS1877654126	1.5000 % INVSA 1 1/2 09/12/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	88.66%	177'324.00	0.02	a)
XS1877836079	1.0000 % ADM 1 09/12/25	250	0	0	250 EUR	95.50%	238'747.50	0.03	a)
XS1877846110	1.4950 % TELEFO 1.495 09/11/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.76%	193'522.00	0.03	a)
XS1877937851	2.1950 % FIREIT 2.195 09/11/25 EMTN	150	0	0	150 EUR	97.77%	146'652.00	0.02	a)
XS1878191219	1.5000 % AMSSM 1 1/2 09/18/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.88%	191'756.00	0.03	a)
XS1878266326	1.3750 % STEDIN 1 3/8 09/19/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.31%	182'626.00	0.03	a)
XS1879112495	2.0000 % GIVNVX 2 09/17/30 EUR	300	0	0	300 EUR	91.05%	273'153.00	0.04	a)
XS1881593971	1.8750 % SGOPP 1 7/8 09/21/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	93.48%	186'960.00	0.03	a)
XS1882544973	2.0000 % INTNED 2 09/20/28 EMTN	500	0	0	500 EUR	93.26%	466'315.00	0.06	a)
XS1883245331	1.7500 % DXC 1 3/4 01/15/26	250	0	0	250 EUR	95.34%	238'352.50	0.03	a)
XS1883352095	1.1250 % JAPTOB 1 1/8 09/28/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1883355197	1.5000 % ABT 1 1/2 09/27/26 EUR	400	0	0	400 EUR	95.42%	381'696.00	0.05	a)
XS1883878966	2.3750 % DPWDU 2 3/8 09/25/26 REGS	250	0	0	250 EUR	95.81%	239'522.50	0.03	a)
XS1888229249	1.2500 % BERTEL 1 1/4 09/29/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	96.17%	192'332.00	0.03	a)
XS1890836296	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 12/15/28	150	0	0	150 EUR	91.76%	137'632.50	0.02	a)
XS1890845875	3.2500 % IBESM 3 1/4 PERP	400	0	0	400 EUR	98.77%	395'068.00	0.05	a)
XS1891174341	2.5000 % DLR 2 1/2 01/16/26	300	0	0	300 EUR	96.95%	290'856.00	0.04	a)
XS1891336932	2.8750 % PLNIJ 2 7/8 10/25/25 REGS	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1893621026	1.8750 % EDPL 1 7/8 10/13/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.11%	242'762.50	0.03	a)
XS1893631769	2.2500 % VW 2 1/4 10/16/26 EMTN	300	300	300	300 EUR	97.01%	291'042.00	0.04	a)
XS1896660989	1.0000 % DGELN 1 04/22/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.98%	96'976.00	0.01	a)
XS1896662175	1.5000 % DGELN 1 1/2 10/22/27 EMTN	150	0	0	150 EUR	93.80%	140'694.00	0.02	a)
XS1898256257	1.0000 % SLB 1 02/18/26	0	200	0	200 EUR	95.09%	190'174.00	0.03	a)
XS1900101046	1.5000 % LUCSHI 1 1/2 11/05/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	87.94%	175'876.00	0.02	a)
XS1900750107	0.6250 % PG 0 5/8 10/30/24	300	0	0	300 EUR	97.98%	293'931.00	0.04	a)
XS1900752814	1.2000 % PG 1.2 10/30/28	200	0	0	200 EUR	91.57%	183'138.00	0.03	a)
XS1900752905	1.8750 % PG 1 7/8 10/30/38	250	0	0	250 EUR	83.53%	208'832.50	0.03	a)
XS1901055472	1.8750 % ENBW 1 7/8 10/31/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.91%	169'810.00	0.02	a)
XS1901137361	2.1250 % CE 2 1/8 03/01/27	0	150	0	150 EUR	94.24%	141'355.50	0.02	a)
XS1903442744	2.1250 % ESBIRE 2 1/8 11/05/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	87.26%	174'514.00	0.02	a)
XS1907120528	1.8000 % T 1.8 09/05/26	500	0	0	500 EUR	95.55%	477'725.00	0.07	a)
XS1907120791	2.3500 % T 2.35 09/05/29	450	0	0	450 EUR	93.63%	421'345.35	0.06	a)
XS1907122656	1.5000 % CCEP 1 1/2 11/08/27	300	0	0	300 EUR	93.07%	279'213.00	0.04	a)
XS1907150350	1.1250 % TELBSS 1 1/8 05/15/24 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1907150780	2.1250 % TELBSS 2 1/8 05/15/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.21%	188'428.00	0.03	a)
XS1909057306	2.2500 % LOGICR 2 1/4 05/13/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.31%	194'628.00	0.03	a)
XS1909057645	3.2500 % LOGICR 3 1/4 11/13/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.72%	189'448.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1909186451	2.5000 % INTNED 2 1/2 11/15/30 EMTN	400	0	0	400 EUR	93.30%	373'188.00	0.05	a)
XS1910245676	1.0000 % BMW 1 11/14/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.16%	294'465.00	0.04	a)
XS1910948162	2.6250 % VW 2 5/8 11/16/27	200	200	200	200 EUR	96.17%	192'336.00	0.03	a)
XS1910948329	3.2500 % VW 3 1/4 11/18/30	400	300	400	300 EUR	96.47%	289'419.00	0.04	a)
XS1910948675	4.1250 % VW 4 1/8 11/16/38	400	400	400	400 EUR	100.13%	400'532.00	0.05	a)
XS1914502304	2.1250 % SYK 2 1/8 11/30/27	150	100	0	250 EUR	95.43%	238'567.50	0.03	a)
XS1914502643	2.6250 % SYK 2 5/8 11/30/30	150	0	0	150 EUR	94.10%	141'142.50	0.02	a)
XS1915689746	1.2500 % EMR 1 1/4 10/15/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	96.30%	192'602.00	0.03	a)
XS1916073254	2.0000 % EMR 2 10/15/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.75%	185'506.00	0.03	a)
XS1917358621	1.6250 % DHLGR 1 5/8 12/05/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	93.02%	232'537.50	0.03	a)
XS1917590959	1.8750 % OMVAV 1 7/8 12/04/28 EMTN	150	0	0	150 EUR	93.45%	140'173.50	0.02	a)
XS1918000107	1.7500 % LSELN 1 3/4 12/06/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.40%	283'194.00	0.04	a)
XS1933820372	2.1250 % INTNED 2 1/8 01/10/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.09%	291'261.00	0.04	a)
XS1936208252	1.8750 % FREGR 1 7/8 02/15/25 6Y	200	0	0	200 EUR	97.97%	195'948.00	0.03	a)
XS1936208419	2.8750 % FREGR 2 7/8 02/15/29 10Y	100	0	0	100 EUR	97.19%	97'192.00	0.01	a)
XS1936805776	2.3750 % CABKSM 2 3/8 02/01/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1937665955	1.5000 % ENELIM 1 1/2 07/21/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	97.04%	388'148.00	0.05	a)
XS1939356645	2.2000 % GM 2.2 04/01/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1941841311	3.8750 % ASSGEN 3 7/8 01/29/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	100.21%	200'418.00	0.03	a)
XS1942708527	2.7500 % ZURNVX 2 3/4 02/19/49	120	0	0	120 EUR	92.94%	111'531.60	0.02	a)
XS1944390241	1.8750 % VW 1 7/8 01/31/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1944390597	2.5000 % VW 2 1/2 07/31/26 EMTN	200	200	200	200 EUR	96.78%	193'568.00	0.03	a)
XS1944456109	0.8750 % IBM 0 7/8 01/31/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.44%	292'323.00	0.04	a)
XS1945110606	1.2500 % IBM 1 1/4 01/29/27	300	0	0	300 EUR	94.19%	282'576.00	0.04	a)
XS1945110861	1.7500 % IBM 1 3/4 01/31/31	500	0	0	500 EUR	89.44%	447'190.00	0.06	a)
XS1946004451	1.0690 % TELEFO 1.069 02/05/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1948611840	1.5000 % BMW 1 1/2 02/06/29 EMTN	500	0	0	500 EUR	91.77%	458'840.00	0.06	a)
XS1951220596	3.7500 % CABKSM 3 3/4 02/15/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1953240261	2.1250 % TELIAS 2 1/8 02/20/34 EMTN	150	0	0	150 EUR	87.99%	131'989.50	0.02	a)
XS1953271225	4.8750 % UCGIM 4 7/8 02/20/29 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1953929608	2.8000 % ACQUIU 2.8 02/20/26	200	0	0	200 EUR	97.35%	194'696.00	0.03	a)
XS1955024986	1.2500 % KO 1 1/4 03/08/31	200	0	0	200 EUR	87.24%	174'478.00	0.02	a)
XS1955187692	0.3000 % SIEGR 0.3 02/28/24	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1955187775	0.9000 % SIEGR 0.9 02/28/28	200	0	0	200 EUR	91.59%	183'174.00	0.03	a)
XS1955187858	1.2500 % SIEGR 1 1/4 02/28/31	250	0	0	250 EUR	87.50%	218'747.50	0.03	a)
XS1955187932	1.7500 % SIEGR 1 3/4 02/28/39 EMTN	230	0	0	230 EUR	79.23%	182'226.70	0.03	a)
XS1956022716	0.3750 % OPBANK 0 3/8 02/26/24 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1956025651	1.0000 % SANSCF 1 02/27/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1956027947	2.1250 % FUMVFH 2 1/8 02/27/29 EMTN	150	0	0	150 EUR	92.71%	139'065.00	0.02	a)
XS1956037664	1.6250 % FUMVFH 1 5/8 02/27/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	95.67%	239'167.50	0.03	a)
XS1956955980	0.6250 % RABOBK 0 5/8 02/27/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1957442541	1.2500 % SRGIM 1 1/4 08/28/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.59%	96'587.00	0.01	a)
XS1958307461	1.7500 % ACAFP 1 3/4 03/05/29 EMTN	0	500	0	500 EUR	90.97%	454'835.00	0.06	a)
XS1958646082	0.5000 % CL 0 1/2 03/06/26	150	0	0	150 EUR	94.61%	141'915.00	0.02	a)
XS1958648294	1.3750 % CL 1 3/8 03/06/34 EMTN	200	0	0	200 EUR	83.75%	167'500.00	0.02	a)
XS1960248919	1.0900 % JPM 1.09 03/11/27 EMTN	0	600	0	600 EUR	94.72%	568'326.00	0.08	a)
XS1960260021	1.3750 % LPTY 1 3/8 03/07/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1960678255	1.1250 % MDT 1 1/8 03/07/27	500	0	0	500 EUR	93.20%	466'020.00	0.06	a)
XS1960678412	1.6250 % MDT 1 5/8 03/07/31	320	0	0	320 EUR	88.58%	283'456.00	0.04	a)
XS1960678685	2.2500 % MDT 2 1/4 03/07/39	300	0	0	300 EUR	82.55%	247'635.00	0.03	a)
XS1960685383	2.0000 % NOKIA 2 03/11/26 EMTN	0	380	0	380 EUR	96.02%	364'868.40	0.05	a)
XS1961772560	1.7880 % TELEFO 1.788 03/12/29 EMTN	400	0	0	400 EUR	92.34%	369'360.00	0.05	a)
XS1962513674	1.6250 % AALLN 1 5/8 03/11/26 EMTN	500	0	0	500 EUR	95.85%	479'265.00	0.07	a)
XS1962554785	0.6250 % SGOPF 0 5/8 03/15/24	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1962571011	1.8750 % SGOPF 1 7/8 03/15/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.42%	268'248.00	0.04	a)
XS1963116964	2.5340 % SRENVX 2.534 04/30/50	200	200	200	200 EUR	90.58%	181'154.00	0.02	a)
XS1963553919	0.7500 % PEP 0 3/4 03/18/27	200	0	0	200 EUR	92.73%	185'458.00	0.03	a)
XS1963555617	1.1250 % PEP 1 1/8 03/18/31	200	0	0	200 EUR	86.57%	173'138.00	0.02	a)
XS1963745234	1.6000 % MCD 1.6 03/15/31	0	100	0	100 EUR	87.49%	87'492.00	0.01	a)
XS1963836892	1.3490 % MMC 1.349 09/21/26	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS1963837197	1.9790 % MMC 1.979 03/21/30	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1963849440	1.6250 % DANBNK 1 5/8 03/15/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1966038249	1.3750 % TLSAU 1 3/8 03/26/29 EMTN	0	250	0	250 EUR	90.65%	226'622.50	0.03	a)
XS1967635977	2.3750 % ABESM 2 3/8 09/27/27 EMTN	500	0	0	500 EUR	95.32%	476'600.00	0.07	a)
XS1967636199	3.0000 % ABESM 3 03/27/31 EMTN	400	0	0	400 EUR	93.43%	373'700.00	0.05	a)
XS1967697738	2.5000 % DANBNK 2 1/2 06/21/29 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1968706108	2.0000 % ACAFP 2 03/25/29 EMTN	0	400	0	400 EUR	90.49%	361'964.00	0.05	a)
XS1968706520	1.4500 % SCGAU 1.45 03/28/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	88.97%	88'972.00	0.01	a)
XS1968846532	1.1250 % CABKSM 1 1/8 03/27/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.82%	189'630.00	0.03	a)
XS1969600748	1.7500 % CNHI 1 3/4 03/25/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.65%	189'302.00	0.03	a)
XS1972547696	2.2500 % VW 2 1/4 10/01/27 EMTN	300	300	300	300 EUR	95.86%	287'592.00	0.04	a)
XS1972548231	1.5000 % VW 1 1/2 10/01/24 EMTN	280	0	280	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1973750869	1.6250 % BACRED 1 5/8 01/07/25 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1974787480	1.7500 % TTEFP 1 3/4 PERP EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1979259220	0.3750 % MET 0 3/8 04/09/24	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1979262448	0.2500 % DNBNO 0 1/4 04/09/24	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1979280853	0.8750 % VZ 0 7/8 04/08/27	0	450	0	450 EUR	92.53%	416'389.50	0.06	a)
XS1979280937	1.2500 % VZ 1 1/4 04/08/30	0	400	0	400 EUR	87.22%	348'872.00	0.05	a)
XS1979446843	1.5000 % ISPIM 1 1/2 04/10/24 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1980064833	1.2500 % C 1 1/4 04/10/29 EMTN	600	0	0	600 EUR	88.76%	532'536.00	0.07	a)
XS1980270810	1.0000 % TRNIM 1 04/10/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.90%	189'808.00	0.03	a)
XS1981054221	1.1250 % CCEP 1 1/8 04/12/29	100	0	0	100 EUR	88.86%	88'861.00	0.01	a)
XS1982037696	0.5000 % ABNANV 0 1/2 04/15/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.37%	283'113.00	0.04	a)
XS1982725159	0.3750 % ERSTBK 0 3/8 04/16/24 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1985806600	0.3750 % TD 0 3/8 04/25/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1986416268	0.8750 % SIKASW 0 7/8 04/29/27	0	200	0	200 EUR	92.25%	184'496.00	0.03	a)
XS1986416698	1.5000 % SIKASW 1 1/2 04/29/31	0	200	0	200 EUR	87.48%	174'958.00	0.02	a)
XS1987142673	0.5000 % BNS 0 1/2 04/30/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1989380172	3.8750 % NFLX 3 7/8 11/15/29 REGS	0	400	0	400 EUR	101.25%	404'996.00	0.06	a)
XS1989708836	3.3750 % ASRND 3 3/8 05/02/49	200	0	0	200 EUR	93.24%	186'472.00	0.03	a)
XS1991125896	0.3750 % CM 0 3/8 05/03/24 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1991126431	1.1250 % RABOBK 1 1/8 05/07/31 GMTN	300	0	0	300 EUR	83.71%	251'127.00	0.03	a)
XS1991190361	1.5000 % CESDRA 1 1/2 05/23/26	200	0	0	200 EUR	94.82%	189'646.00	0.03	a)
XS1991265395	1.3810 % BAC 1.381 05/09/30 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1991265478	0.8080 % BAC 0.808 05/09/26 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1992927902	1.2310 % BPLN 1.231 05/08/31 EMTN	300	500	0	800 EUR	84.94%	679'544.00	0.09	a)
XS1995716211	3.3750 % SAMPFH 3 3/8 05/23/49	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1995781546	1.0000 % CCHLN 1 05/14/27 EMTN	0	250	0	250 EUR	92.48%	231'190.00	0.03	a)
XS1995795504	1.6250 % CCHLN 1 5/8 05/14/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	87.83%	175'654.00	0.02	a)
XS1996269061	0.6970 % ETN 0.697 05/14/25	150	0	0	150 EUR	96.43%	144'645.00	0.02	a)
XS1996435688	1.0000 % CEPESA 1 02/16/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.21%	194'426.00	0.03	a)
XS1996441066	0.8750 % RTOLN 0 7/8 05/30/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	94.25%	141'378.00	0.02	a)
XS1997077364	1.4500 % TCLAU 1.45 05/16/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.59%	179'172.00	0.02	a)
XS1998215393	0.4000 % BAX 0.4 05/15/24 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1998215559	1.3000 % BAX 1.3 05/15/29	300	0	0	300 EUR	88.69%	266'067.00	0.04	a)
XS1998797663	0.2500 % NAB 0 1/4 05/20/24 GMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS1998798042	1.1250 % NAB 1 1/8 05/20/31 GMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2000504444	3.6250 % LIBMUT 3 5/8 05/23/59 REGS	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2000538343	0.8750 % ERSTBK 0 7/8 05/22/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2000719992	3.5000 % ENELIM 3 1/2 PERP	250	0	0	250 EUR	98.69%	246'717.50	0.03	a)
XS2001175657	0.5000 % PHIANA 0 1/2 05/22/26	200	0	0	200 EUR	92.91%	185'824.00	0.03	a)
XS2001183164	1.5000 % VESTNL 1 1/2 05/24/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.86%	185'726.00	0.03	a)
XS2001278899	1.7500 % ACEIM 1 3/4 05/23/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.43%	184'868.00	0.03	a)
XS2001737910	1.1250 % TELNO 1 1/8 05/31/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.06%	267'192.00	0.04	a)
XS2001738991	1.7500 % TELNO 1 3/4 05/31/34 EMTN	150	0	0	150 EUR	84.81%	127'216.50	0.02	a)
XS2002017361	0.9000 % VOD 0.9 11/24/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.73%	187'450.00	0.03	a)
XS2002018500	1.6250 % VOD 1 5/8 11/24/30 EMTN	150	200	0	350 EUR	88.49%	309'722.00	0.04	a)
XS2002019060	2.5000 % VOD 2 1/2 05/24/39 EMTN	250	0	0	250 EUR	84.51%	211'267.50	0.03	a)
XS2002491517	1.0000 % NWG 1 05/28/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2002491863	1.5000 % TENN 1 1/2 06/03/39 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2002532724	1.2080 % BDX 1.208 06/04/26	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2003442436	1.2500 % AIB 1 1/4 05/28/24 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2003499386	0.3750 % NDAFH 0 3/8 05/28/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	93.45%	140'169.00	0.02	a)
XS2004381245	1.5350 % TTEFP 1.535 05/31/39 EMTN	200	0	0	200 EUR	76.33%	152'664.00	0.02	a)
XS2004381674	0.6960 % TTEFP 0.696 05/31/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.41%	89'413.00	0.01	a)
XS2006277508	0.7500 % AMXLMM 0 3/4 06/26/27 EMTN	500	0	0	500 EUR	91.49%	457'465.00	0.06	a)
XS2006909407	1.3750 % BRTFOD 1 3/8 06/19/24	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2008921947	0.6250 % AEGON 0 5/8 06/21/24	200	0	0	200 EUR	98.95%	197'904.00	0.03	a)
XS2008925344	1.5000 % UNANA 1 1/2 06/11/39	100	100	0	200 EUR	77.69%	155'380.00	0.02	a)
XS2009861480	1.1250 % ESBIRE 1 1/8 06/11/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	86.93%	217'317.50	0.03	a)
XS2009891479	0.5000 % VATFAL 0 1/2 06/24/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.15%	186'306.00	0.03	a)
XS2009943379	1.1250 % ENXFP 1 1/8 06/12/29	0	300	0	300 EUR	89.07%	267'222.00	0.04	a)
XS2010032022	1.7500 % TMO 1 3/4 04/15/27	0	200	0	200 EUR	95.04%	190'076.00	0.03	a)
XS2010032378	0.2500 % ASML 0 1/4 02/25/30	250	0	0	250 EUR	84.50%	211'257.50	0.03	a)
XS2010032451	2.3750 % TMO 2 3/8 04/15/32	0	200	0	200 EUR	92.16%	184'318.00	0.03	a)
XS2010032881	0.8750 % NDAQ 0 7/8 02/13/30	0	150	0	150 EUR	85.21%	127'816.50	0.02	a)
XS2010036874	1.7500 % ORSTED 1 3/4 12/09/3019	150	0	0	150 EUR	89.38%	134'062.50	0.02	a)
XS2010038227	0.9500 % MCO 0.95 02/25/30	250	0	0	250 EUR	85.66%	214'147.50	0.03	a)
XS2010038730	0.7500 % DOV 0 3/4 11/04/27	0	200	0	200 EUR	90.32%	180'648.00	0.02	a)
XS2010044209	0.5000 % SLB 0 1/2 10/15/31	0	300	0	300 EUR	80.32%	240'957.00	0.03	a)
XS2010045198	0.2500 % SLB 0 1/4 10/15/27	0	300	0	300 EUR	89.51%	268'521.00	0.04	a)
XS2010045511	2.1250 % NGGLN 2 1/8 09/05/2082	250	0	0	250 EUR	91.25%	228'125.00	0.03	a)
XS2010331101	1.6500 % DE 1.65 06/13/39 EMTN	250	0	0	250 EUR	78.91%	197'265.00	0.03	a)
XS2010447238	0.7500 % BMW 0 3/4 07/13/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.28%	188'550.00	0.03	a)
XS2011260531	1.6250 % MRKGR 1 5/8 06/25/2079	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2011260705	2.8750 % MRKGR 2 7/8 06/25/2079	300	0	0	300 EUR	92.13%	276'375.00	0.04	a)
XS2012047127	0.3750 % BZLNZ 0 3/8 09/14/24 GMTN	250	0	0	250 EUR	98.10%	245'252.50	0.03	a)
XS2013539635	1.0000 % SGTOPT 1 06/20/29 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2013574038	1.3750 % CABKSM 1 3/8 06/19/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	94.50%	377'992.00	0.05	a)
XS2013574384	2.3860 % F 2.386 02/17/26	0	300	0	300 EUR	96.49%	289'473.00	0.04	a)
XS2013618421	0.8750 % ISSDC 0 7/8 06/18/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.30%	186'596.00	0.03	a)
XS2013626010	1.6250 % ZURNVX 1 5/8 06/17/39 EMTN	200	0	0	200 EUR	77.91%	155'822.00	0.02	a)
XS2013745703	1.0000 % BBVASM 1 06/21/26	300	0	0	300 EUR	94.20%	282'594.00	0.04	a)
XS2014287937	0.2500 % SANTAN 0 1/4 06/19/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2014288158	0.3750 % OPBANK 0 3/8 06/19/24 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2014291616	1.5000 % VW 1 1/2 06/19/26 EMTN	200	200	200	200 EUR	95.14%	190'280.00	0.03	a)
XS2015240083	1.5000 % SEGPLP 1 1/2 12/20/26	200	0	0	200 EUR	94.08%	188'168.00	0.03	a)
XS2015267953	0.6250 % BSTLAF 0 5/8 06/21/24	150	0	0	150 EUR	99.01%	148'512.00	0.02	a)
XS2015314037	2.6250 % ISPIM 2 5/8 06/20/24 EMTN	250	0	0	250 EUR	99.57%	248'925.00	0.03	a)
XS2015329498	1.5000 % INVSA 1 1/2 06/20/39 EMTN	0	200	0	200 EUR	74.74%	149'478.00	0.02	a)
XS2017471553	1.2500 % UCGIM 1 1/4 06/25/25 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2018636600	0.2500 % ADNA 0 1/4 06/26/25	200	0	0	200 EUR	95.65%	191'298.00	0.03	a)
XS2018637913	0.3750 % SANSCF 0 3/8 06/27/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.89%	296'658.00	0.04	a)
XS2019814503	0.8000 % OMC 0.8 07/08/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	91.26%	182'518.00	0.03	a)
XS2019815062	1.4000 % OMC 1.4 07/08/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	86.25%	172'496.00	0.02	a)
XS2020568734	0.0500 % SEB 0.05 07/01/24 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2020581752	1.5000 % IAGLN 1 1/2 07/04/27	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2020583618	1.9570 % TELEFO 1.957 07/01/39	200	0	0	200 EUR	76.43%	152'862.00	0.02	a)
XS2020670779	0.2500 % MDT 0 1/4 07/02/25	400	0	0	400 EUR	95.57%	382'272.00	0.05	a)
XS2020670852	1.0000 % MDT 1 07/02/31	300	0	0	300 EUR	84.06%	252'186.00	0.03	a)
XS2020670936	1.5000 % MDT 1 1/2 07/02/39	300	0	0	300 EUR	73.61%	220'815.00	0.03	a)
XS2020671157	1.7500 % MDT 1 3/4 07/02/49	350	0	0	350 EUR	67.36%	235'767.00	0.03	a)
XS2021467753	0.9000 % STANLN 0.9 07/02/27 EMTN	150	0	0	150 EUR	93.35%	140'022.00	0.02	a)
XS2021471433	0.3750 % MOTOPG 0 3/8 01/03/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.20%	235'495.00	0.03	a)
XS2021993212	1.6250 % UCGIM 1 5/8 07/03/25 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2022084367	1.6250 % CNHI 1 5/8 07/03/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.70%	179'396.00	0.02	a)
XS2022093434	0.0000 % OMVAV 0 07/03/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.44%	190'886.00	0.03	a)
XS2022093517	1.0000 % OMVAV 1 07/03/34 EMTN	150	0	0	150 EUR	76.83%	115'246.50	0.02	a)
XS2022424993	1.7500 % ISPIM 1 3/4 07/04/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	90.91%	272'715.00	0.04	a)
XS2022425297	1.0000 % ISPIM 1 07/04/24 EMTN	350	0	0	350 EUR	99.04%	346'633.00	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2023631489	0.8750 % NIBCAP 0 7/8 07/08/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.86%	191'712.00	0.03	a)
XS2023644201	0.3750 % MRKGR 0 3/8 07/05/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.79%	181'570.00	0.02	a)
XS2023644540	0.8750 % MRKGR 0 7/8 07/05/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	84.10%	252'291.00	0.03	a)
XS2023872174	0.6250 % ARNDTN 0 5/8 07/09/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	94.00%	188'000.00	0.03	a)
XS2023873149	1.4500 % ARNDTN 1.45 07/09/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	80.50%	161'000.00	0.02	a)
XS2024715794	0.5000 % DT 0 1/2 07/05/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2024716099	1.3750 % DT 1 3/8 07/05/34 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2025466413	0.6250 % ABESM 0 5/8 07/15/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.80%	191'602.00	0.03	a)
XS2027364244	0.7500 % LOGICR 0 3/4 07/15/24 EMTN	250	0	0	250 EUR	98.67%	246'675.00	0.03	a)
XS2027364327	1.6250 % LOGICR 1 5/8 07/15/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	90.64%	271'929.00	0.04	a)
XS2027957815	1.1250 % BACRED 1 1/8 07/15/25 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2028816028	0.8750 % SABSM 0 7/8 07/22/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.18%	288'528.00	0.04	a)
XS2028900087	0.8480 % MUFU 0.848 07/19/29	0	200	0	200 EUR	87.92%	175'830.00	0.02	a)
XS2031862076	0.1250 % RY 0 1/8 07/23/24	350	0	0	350 EUR	98.55%	344'932.00	0.05	a)
XS2032727310	0.8750 % IGIM 0 7/8 04/24/30 EMTN	150	0	0	150 EUR	84.89%	127'329.00	0.02	a)
XS2033262622	1.0010 % JPM 1.001 07/25/31 EMTN	0	500	0	500 EUR	84.25%	421'270.00	0.06	a)
XS2034626460	0.4500 % FDX 0.45 08/05/25	200	0	0	200 EUR	95.44%	190'886.00	0.03	a)
XS2034629134	1.3000 % FDX 1.3 08/05/31	200	0	0	200 EUR	84.13%	168'256.00	0.02	a)
XS2035564629	1.6250 % ENBW 1 5/8 08/05/2079	200	0	0	200 EUR	90.05%	180'098.00	0.02	a)
XS2035564975	1.1250 % ENBW 1 1/8 11/05/2079	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2035620710	0.2500 % REPSM 0 1/4 08/02/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2038039074	0.5800 % BAC 0.58 08/08/29 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2042667944	0.6250 % KYGID 0 5/8 09/20/29	250	0	0	250 EUR	85.77%	214'422.50	0.03	a)
XS2043678841	0.1250 % GS 0 1/8 08/19/24 EMTN	337	0	0	337 EUR	98.28%	331'210.34	0.05	a)
XS2046595836	0.5000 % DANBNK 0 1/2 08/27/25	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2047479469	0.5000 % HELLA 0 1/2 01/26/27	0	200	0	200 EUR	90.55%	181'094.00	0.02	a)
XS2047500926	0.3500 % EOANGR 0.35 02/28/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	83.85%	251'541.00	0.03	a)
XS2049090595	0.1250 % VGASDE 0 1/8 09/10/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2049146215	0.5000 % VGASDE 0 1/2 09/10/34 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2049154078	0.1000 % INTNED 0.1 09/03/25 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2049582542	0.0500 % SHBASS 0.05 09/03/26	0	300	0	300 EUR	91.53%	274'587.00	0.04	a)
XS2049583607	0.6250 % PLD 0 5/8 09/10/31	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2049583789	1.5000 % PLD 1 1/2 09/10/49	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2049616548	0.0000 % SIEGR 0 09/05/24	200	0	0	200 EUR	98.12%	196'238.00	0.03	a)
XS2049616621	0.1250 % SIEGR 0 1/8 09/05/29	400	0	0	400 EUR	85.80%	343'192.00	0.05	a)
XS2049616894	0.5000 % SIEGR 0 1/2 09/05/34 EMTN	300	0	0	300 EUR	74.99%	224'955.00	0.03	a)
XS2049630028	0.4020 % MIZUHO 0.402 09/06/29 EMTN	0	150	0	150 EUR	83.28%	124'915.50	0.02	a)
XS2049630887	0.1180 % MIZUHO 0.118 09/06/24 EMTN	0	100	0	100 EUR	98.09%	98'090.00	0.01	a)
XS2049707180	0.1250 % BNS 0 1/8 09/04/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	91.84%	275'505.00	0.04	a)
XS2049769297	0.8750 % MOLNLY 0 7/8 09/05/29 EMTN	150	0	0	150 EUR	84.60%	126'898.50	0.02	a)
XS2049823763	1.5000 % RBAIV 1 1/2 03/12/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.37%	188'746.00	0.03	a)
XS2050404636	0.2000 % DHR 0.2 03/18/26	0	400	0	400 EUR	93.54%	374'152.40	0.05	a)
XS2050404800	0.4500 % DHR 0.45 03/18/28	0	400	0	400 EUR	89.18%	356'702.40	0.05	a)
XS2050406094	0.7500 % DHR 0 3/4 09/18/31	0	500	0	500 EUR	82.35%	411'730.00	0.06	a)
XS2050406177	1.3500 % DHR 1.35 09/18/39	0	400	0	400 EUR	73.50%	293'984.00	0.04	a)
XS2050543839	1.3750 % ITVLN 1 3/8 09/26/26	250	0	0	250 EUR	93.58%	233'937.50	0.03	a)
XS2050945984	0.1250 % SCBNOR 0 1/8 09/11/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.03%	196'058.00	0.03	a)
XS2050968333	1.5000 % SKGID 1 1/2 09/15/27	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2051149552	1.8000 % DHR 1.8 09/18/49	0	300	0	300 EUR	69.09%	207'276.00	0.03	a)
XS2051361264	0.2500 % T 0 1/4 03/04/26	300	0	0	300 EUR	93.67%	281'022.00	0.04	a)
XS2051362072	0.8000 % T 0.8 03/04/30	300	100	0	400 EUR	84.91%	339'648.00	0.05	a)
XS2051362312	1.8000 % T 1.8 09/14/39	100	0	0	100 EUR	74.65%	74'653.00	0.01	a)
XS2051494222	0.5000 % BRITEL 0 1/2 09/12/25 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2051494495	1.1250 % BRITEL 1 1/8 09/12/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2051660335	0.0000 % SRGIM 0 05/12/24	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2051660509	1.0000 % SRGIM 1 09/12/34 EMTN	200	0	0	200 EUR	75.39%	150'784.00	0.02	a)
XS2051664675	1.3750 % BABLN 1 3/8 09/13/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.35%	182'694.00	0.03	a)
XS2051777873	0.8750 % SMDSLN 0 7/8 09/12/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	93.10%	232'760.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2051914963	0.5000 % CAABNK 0 1/2 09/13/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.18%	294'525.00	0.04	a)
XS2052310054	0.8750 % LYB 0 7/8 09/17/26	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2052313827	1.6250 % LYB 1 5/8 09/17/31	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2052320954	0.8750 % VZ 0 7/8 03/19/32	0	300	0	300 EUR	80.73%	242'196.00	0.03	a)
XS2052321093	1.5000 % VZ 1 1/2 09/19/39	0	100	0	100 EUR	72.57%	72'567.00	0.01	a)
XS2052337503	2.3300 % F 2.33 11/25/25	0	200	0	200 EUR	96.80%	193'590.00	0.03	a)
XS2052998403	0.3750 % ANZNZ 0 3/8 09/17/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.50%	169'008.00	0.02	a)
XS2053052895	0.3750 % EDPPL 0 3/8 09/16/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	92.42%	369'668.00	0.05	a)
XS2054209833	0.8400 % WNTRDE 0.84 09/25/25	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2054210252	1.3320 % WNTRDE 1.332 09/25/28	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2055079904	1.8230 % WNTRDE 1.823 09/25/31	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2055089457	2.0000 % UCGIM 2 09/23/29 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2055104785	0.5000 % ASBBNK 0 1/2 09/24/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.61%	169'226.00	0.02	a)
XS2055106137	0.8750 % HTOGA 0 7/8 09/24/26 GMTN	0	200	0	200 EUR	93.30%	186'606.00	0.03	a)
XS2055627538	0.3750 % RBAIV 0 3/8 09/25/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.38%	182'750.00	0.03	a)
XS2055647213	1.2500 % ABBV 1 1/4 11/18/31	100	0	0	100 EUR	84.74%	84'744.00	0.01	a)
XS2055651918	1.1250 % ABESM 1 1/8 03/26/28	300	0	0	300 EUR	90.01%	270'036.00	0.04	a)
XS2055652056	1.8750 % ABESM 1 7/8 03/26/32	200	0	0	200 EUR	84.49%	168'972.00	0.02	a)
XS2056374353	0.8750 % MDLZ 0 7/8 10/01/31 REGS	0	200	0	200 EUR	82.06%	164'126.00	0.02	a)
XS2056399855	0.6250 % TELNO 0 5/8 09/25/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.12%	162'232.00	0.02	a)
XS2056400299	0.6250 % WFC 0 5/8 03/25/30 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2056430874	0.3750 % CONGR 0 3/8 06/27/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.95%	191'890.00	0.03	a)
XS2056491587	2.1240 % ASSGEN 2.124 10/01/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.62%	175'244.00	0.02	a)
XS2057069093	0.7500 % CKHGTH 0 3/4 04/17/26	0	350	0	350 EUR	93.64%	327'747.00	0.04	a)
XS2057069762	1.1250 % CKHGTH 1 1/8 10/17/28	0	250	0	250 EUR	89.61%	224'027.50	0.03	a)
XS2057070182	1.5000 % CKHGTH 1 1/2 10/17/31	0	250	0	250 EUR	83.80%	209'500.00	0.03	a)
XS2058556536	0.5000 % TMO 0 1/2 03/01/28	0	400	0	400 EUR	89.34%	357'352.00	0.05	a)
XS2058556619	0.8750 % TMO 0 7/8 10/01/31	0	300	0	300 EUR	82.80%	248'397.00	0.03	a)
XS2058557260	1.5000 % TMO 1 1/2 10/01/39 EMTN	0	300	0	300 EUR	73.76%	221'265.00	0.03	a)
XS2058557344	1.8750 % TMO 1 7/8 10/01/49 EMTN	0	350	0	350 EUR	69.06%	241'717.00	0.03	a)
XS2058729653	0.3750 % BBVASM 0 3/8 10/02/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.98%	293'943.00	0.04	a)
XS2062490649	2.0450 % ENAPHO 2.045 10/09/28	200	0	0	200 EUR	85.70%	171'406.00	0.02	a)
XS2063232727	0.5000 % C 0 1/2 10/08/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	91.91%	367'636.00	0.05	a)
XS2063246198	1.3750 % AMCOSP 1 3/8 01/27/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.51%	195'014.00	0.03	a)
XS2063247915	0.3000 % SANTAN 0.3 10/04/26 EMTN	500	0	0	500 EUR	91.97%	459'835.00	0.06	a)
XS2063261155	0.2500 % SWEDA 0 1/4 10/09/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.84%	195'678.00	0.03	a)
XS2063268754	1.2500 % IDSLN 1 1/4 10/08/26	0	200	0	200 EUR	92.87%	185'744.00	0.03	a)
XS2063350925	1.1250 % HANRUE 1 1/8 10/09/39	200	0	0	200 EUR	84.05%	168'096.00	0.02	a)
XS2063495811	1.1250 % DLR 1 1/8 04/09/28	200	0	0	200 EUR	89.18%	178'354.00	0.02	a)
XS2063535970	1.8750 % NEPSJ 1 7/8 10/09/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.69%	185'380.00	0.03	a)
XS2063659945	0.2500 % SCBGER 0 1/4 10/15/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.81%	195'610.00	0.03	a)
XS2064302735	0.8750 % PEP 0 7/8 10/16/39	200	0	0	200 EUR	70.03%	140'068.00	0.02	a)
XS2065593068	0.2500 % RFLBNI 0 1/4 04/16/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2065946837	1.0000 % ENIIM 1 10/11/34 EMTN	0	100	0	100 EUR	75.24%	75'243.00	0.01	a)
XS2066392452	0.6320 % SUMIBK 0.632 10/23/29 EMTN	0	400	0	400 EUR	84.64%	338'544.00	0.05	a)
XS2066706818	0.0000 % ENELIM 0 06/17/24 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2066706909	0.3750 % ENELIM 0 3/8 06/17/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.10%	180'200.00	0.02	a)
XS2067135421	0.3750 % ACAFP 0 3/8 10/21/25 EMTN	0	300	0	300 EUR	94.90%	284'709.00	0.04	a)
XS2067213913	1.6250 % ISPIM 1 5/8 04/21/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.41%	243'530.00	0.03	a)
XS2068065163	1.2500 % INFLN 1 1/4 04/22/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.06%	180'120.00	0.02	a)
XS2068969067	0.2500 % RABOBK 0 1/4 10/30/26	0	300	0	300 EUR	91.85%	275'562.00	0.04	a)
XS2069380991	0.2500 % EOANGR 0 1/4 10/24/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	92.17%	230'415.00	0.03	a)
XS2069407786XXX	1.6250 % CPIPRGR 1 5/8 04/23/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	82.13%	205'312.50	0.03	a)
XS2070192591	0.6250 % BSX 0 5/8 12/01/27	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2071382662	1.1250 % VCXAU 1 1/8 11/07/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.80%	169'604.00	0.02	a)
XS2072829794	3.6250 % NFLX 3 5/8 06/15/30 REGS	0	400	0	400 EUR	99.63%	398'536.00	0.05	a)
XS2075185228	0.9000 % HOG 0.9 11/19/24	0	200	0	200 EUR	97.91%	195'810.00	0.03	a)
XS2075811948	1.0470 % JPM 1.047 11/04/32 EMTN	0	500	0	500 EUR	81.83%	409'165.00	0.06	a)
XS2075937370	0.6250 % LLY 0 5/8 11/01/31	200	0	0	200 EUR	82.78%	165'560.00	0.02	a)
XS2075938006	1.7000 % LLY 1.7 11/01/49	300	0	0	300 EUR	70.84%	212'523.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2076079594	0.6250 % SABSM 0 5/8 11/07/25	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2076099865	4.6250 % NFLX 4 5/8 05/15/29	0	400	0	400 EUR	104.59%	418'368.00	0.06 a)	
XS2076154801	0.1000 % ABT 0.1 11/19/24	200	0	0	200 EUR	97.42%	194'830.00	0.03 a)	
XS2076155105	0.3750 % ABT 0 3/8 11/19/27	150	0	0	150 EUR	90.42%	135'625.50	0.02 a)	
XS2077546682	0.6250 % EOANGR 0 5/8 11/07/31 EMTN	150	0	0	150 EUR	80.36%	120'537.00	0.02 a)	
XS2078409716	0.8750 % CL 0 7/8 11/12/39 EMTN	150	0	0	150 EUR	68.84%	103'264.50	0.01 a)	
XS2078667925	0.6250 % OPBANK 0 5/8 11/12/29 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2078692105	0.5000 % SANSCF 0 1/2 11/14/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.62%	183'236.00	0.03 a)	
XS2078734626	0.1250 % RDSALN 0 1/8 11/08/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.04%	267'126.00	0.04 a)	
XS2078735276	0.5000 % RDSALN 0 1/2 11/08/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.47%	160'940.00	0.02 a)	
XS2078735433	0.8750 % RDSALN 0 7/8 11/08/39 EMTN	350	0	0	350 EUR	66.41%	232'428.00	0.03 a)	
XS2078737215	0.6250 % SEB 0 5/8 11/12/29 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2078761785	1.3750 % DANBNK 1 3/8 02/12/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.75%	290'253.00	0.04 a)	
XS2078918781	0.5000 % LLOYDS 0 1/2 11/12/25 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2079079799	1.0000 % INTNED 1 11/13/30	300	0	0	300 EUR	94.35%	283'041.00	0.04 a)	
XS2079105891	1.1640 % ZBH 1.164 11/15/27	0	100	0	100 EUR	91.45%	91'445.00	0.01 a)	
XS2079678400	0.5000 % STEDIN 0 1/2 11/14/29 EMTN	150	0	0	150 EUR	84.88%	127'323.00	0.02 a)	
XS2079713322	0.3750 % BBVASM 0 3/8 11/15/26 GMTN	300	0	0	300 EUR	91.79%	275'382.00	0.04 a)	
XS2079716937	0.5000 % AAPL 0 1/2 11/15/31	300	0	0	300 EUR	82.51%	247'542.00	0.03 a)	
XS2080205367	0.7500 % NWG 0 3/4 11/15/25	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2080581189	0.1250 % HESLAN 0 1/8 11/19/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2080767010	1.8750 % AIB 1 7/8 11/19/29 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2080785343	0.5000 % TEMASE 0 1/2 11/20/31 GMTN	200	0	0	200 EUR	80.72%	161'430.00	0.02 a)	
XS2080786150	1.2500 % TEMASE 1 1/4 11/20/49 GMTN	150	0	0	150 EUR	62.45%	93'667.50	0.01 a)	
XS2081016763	1.1040 % BPLN 1.104 11/15/34	300	0	0	300 EUR	76.97%	230'901.00	0.03 a)	
XS2081018629	1.0000 % ISPIM 1 11/19/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.19%	279'567.00	0.04 a)	
XS2082324018	1.7500 % MTNA 1 3/4 11/19/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	96.35%	240'877.50	0.03 a)	
XS2082324364	0.7500 % BACR 0 3/4 06/09/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2082333787	0.3000 % DEKA 0.3 11/20/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.68%	181'356.00	0.02 a)	
XS2082345955	0.6250 % CCHLN 0 5/8 11/21/29	0	200	0	200 EUR	85.23%	170'456.00	0.02 a)	
XS2082429890	1.3750 % TELIAS 1 3/8 05/11/2081	150	0	0	150 EUR	93.38%	140'062.50	0.02 a)	
XS2082472122	1.0000 % JAPT0B 1 11/26/29	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2082818951	1.1250 % ANZ 1 1/8 11/21/29 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2082969655	1.0000 % BKIR 1 11/25/25 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2083147343	1.6250 % ALB 1 5/8 11/25/28	200	0	0	200 EUR	89.78%	179'558.00	0.02 a)	
XS2083210729	1.0000 % ERSTBK 1 06/10/30 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2084050637	0.3750 % NNGRNV 0 3/8 02/26/25	100	0	0	100 EUR	96.54%	96'542.00	0.01 a)	
XS2084418339	0.8750 % CEZCP 0 7/8 12/02/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	91.64%	183'284.00	0.03 a)	
XS2084488209	1.2500 % FMEGR 1 1/4 11/29/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.93%	86'931.00	0.01 a)	
XS2084497705	0.6250 % FMEGR 0 5/8 11/30/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	91.36%	228'402.50	0.03 a)	
XS2085608326	0.6250 % FIS 0 5/8 12/03/25	0	500	0	500 EUR	94.82%	474'075.00	0.07 a)	
XS2086868010	0.8750 % TSCOLN 0 7/8 05/29/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.93%	187'864.00	0.03 a)	
XS2087622069	0.2500 % SYK 0 1/4 12/03/24	400	0	0	400 EUR	97.33%	389'304.00	0.05 a)	
XS2087639626	0.7500 % SYK 0 3/4 03/01/29	300	0	0	300 EUR	87.53%	262'602.00	0.04 a)	
XS2087643651	1.0000 % SYK 1 12/03/31	300	0	0	300 EUR	82.52%	247'554.00	0.03 a)	
XS2089226026	1.7500 % DT 1 3/4 12/09/49 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2089229806	1.8750 % MRLSM 1 7/8 12/04/34	0	200	0	200 EUR	78.96%	157'922.00	0.02 a)	
XS2089368596	0.7500 % ISPIM 0 3/4 12/04/24 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.74%	293'223.00	0.04 a)	
XS2090859252	0.8750 % BACRED 0 7/8 01/15/26	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2098350965	0.7970 % MIZUHO 0.797 04/15/30 EMTN	0	250	0	250 EUR	83.79%	209'470.00	0.03 a)	
XS2099128055	0.8750 % CAIAV 0 7/8 02/05/27	200	200	200	200 EUR	88.60%	177'190.00	0.02 a)	
XS2099546488	0.8750 % ACAFP 0 7/8 01/14/32 EMTN	0	500	0	500 EUR	80.23%	401'155.00	0.06 a)	
XS2100663579	0.6250 % DLR 0 5/8 07/15/25	250	0	0	250 EUR	95.26%	238'155.00	0.03 a)	
XS2100664114	1.5000 % DLR 1 1/2 03/15/30	200	0	0	200 EUR	85.72%	171'446.00	0.02 a)	
XS2100690036	0.3750 % SANSCF 0 3/8 01/17/25 EMTN	400	0	0	400 EUR	97.13%	388'516.00	0.05 a)	
XS2100788780	0.4500 % GIS 0.45 01/15/26	250	0	0	250 EUR	94.24%	235'605.00	0.03 a)	
XS2101349723	0.5000 % BBVASM 0 1/2 01/14/27 GMTN	400	0	0	400 EUR	91.62%	366'464.00	0.05 a)	
XS2101357072	0.7500 % FREGR 0 3/4 01/15/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	89.46%	223'645.00	0.03 a)	
XS2101558307	2.7310 % UCGIM 2.731 01/15/32	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2102283061	0.6000 % ABNAV 0 6/01/15/27	300	100	0	400 EUR	91.99%	367'976.00	0.05	a)
XS2102357014	0.3750 % BMW 0 3/8 01/14/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.23%	184'456.00	0.03	a)
XS2102357105	0.8750 % BMW 0 7/8 01/14/32 EMTN	150	0	0	150 EUR	83.93%	125'890.50	0.02	a)
XS2102360315	0.8500 % STANLN 0.85 01/27/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.35%	182'698.00	0.03	a)
XS2102916793	0.1250 % MRKGR 0 1/8 07/16/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.51%	191'014.00	0.03	a)
XS2102924383	0.6000 % OPBANK 0.6 01/18/27 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2102931594	0.3750 % CABKSM 0 3/8 02/03/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.89%	290'667.00	0.04	a)
XS2102932055	0.5000 % MRKGR 0 1/2 07/16/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.77%	177'540.00	0.02	a)
XS2102948994	0.2500 % TOYOTA 0 1/4 07/16/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	93.17%	279'522.00	0.04	a)
XS2103013210	0.3750 % REESM 0 3/8 07/24/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.68%	266'037.00	0.04	a)
XS2103014291	0.3750 % EOANGR 0 3/8 09/29/27 EMTN	500	0	0	500 EUR	90.08%	450'420.00	0.06	a)
XS2104051433	1.0000 % BBVASM 1 01/16/30 GMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2104915033	0.1900 % NGGLN 0.19 01/20/25	300	0	0	300 EUR	96.89%	290'682.00	0.04	a)
XS2104967695	1.2000 % UCGIM 1.2 01/20/26 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2104968404	1.8000 % UCGIM 1.8 01/20/30	250	0	0	250 EUR	88.70%	221'742.50	0.03	a)
XS2105772201	1.1250 % HEIBOS 1 1/8 01/21/26 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2106056653	0.2500 % RBAIV 0 1/4 01/22/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.72%	193'446.00	0.03	a)
XS2106861771	1.1250 % BACRED 1 1/8 04/23/25 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2107315470	0.6250 % ENIIM 0 5/8 01/23/30 EMTN	0	350	0	350 EUR	84.34%	295'183.00	0.04	a)
XS2107332640	0.8750 % GS 0 7/8 01/21/30 EMTN	400	0	0	400 EUR	85.12%	340'472.00	0.05	a)
XS2107435617	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 01/23/27 GMTN	250	0	0	250 EUR	91.51%	228'782.50	0.03	a)
XS2108490090	0.8750 % PSA 0 7/8 01/24/32	150	0	0	150 EUR	81.09%	121'638.00	0.02	a)
XS2109394077	0.3750 % LLOYDS 0 3/8 01/28/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.00%	97'000.00	0.01	a)
XS2112289207	0.6640 % TELEFO 0.664 02/03/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	85.11%	255'318.00	0.04	a)
XS2112475509	0.3750 % PLD 0 3/8 02/06/28	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2112475921	1.0000 % PLD 1 02/06/35	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2113700921	0.5000 % ACEIM 0 1/2 04/06/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	85.66%	171'318.00	0.02	a)
XS2113889351	0.5000 % SANTAN 0 1/2 02/04/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	91.07%	273'213.00	0.04	a)
XS2113911387	1.2500 % ABESM 1 1/4 02/07/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.54%	181'076.00	0.02	a)
XS2114852218	0.2500 % CMCSA 0 1/4 05/20/27	283	0	283	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2114852564	0.7500 % CMCSA 0 3/4 02/20/32	447	0	447	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2114852721	1.2500 % CMCSA 1 1/4 02/20/40	219	0	219	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2115091717	0.3000 % IBM 0.3 02/11/28	400	0	0	400 EUR	88.84%	355'356.00	0.05	a)
XS2115091808	0.6500 % IBM 0.65 02/11/32	400	0	0	400 EUR	80.06%	320'248.00	0.04	a)
XS2115092012	1.2000 % IBM 1.2 02/11/40	300	0	0	300 EUR	71.14%	213'420.00	0.03	a)
XS2115092954	0.5000 % WHR 0 1/2 02/20/28	250	0	0	250 EUR	87.18%	217'960.00	0.03	a)
XS2115094737	0.3750 % SEB 0 3/8 02/11/27 EMTN	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2116701348	0.7500 % CDTFIN 0 3/4 03/11/32 EMTN	150	0	0	150 EUR	78.82%	118'225.50	0.02	a)
XS2117435904	1.6250 % ICPLN 1 5/8 02/17/27	0	200	0	200 EUR	91.48%	182'952.00	0.03	a)
XS2117454871	0.8750 % TELNO 0 7/8 02/14/35 EMTN	200	0	0	200 EUR	76.62%	153'240.00	0.02	a)
XS2118204200	0.6250 % WFC 0 5/8 08/14/30	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2118213888	0.6250 % ANVAU 0 5/8 08/25/30 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2118273601	0.5000 % SIEGR 0 1/2 02/20/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.35%	160'700.00	0.02	a)
XS2118276026	0.2500 % SIEGR 0 1/4 02/20/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.60%	173'196.00	0.02	a)
XS2118280218	0.0000 % SIEGR 0 02/20/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	93.68%	374'732.00	0.05	a)
XS2121207828	0.5000 % SHBASS 0 1/2 02/18/30	0	300	0	300 EUR	83.40%	250'188.00	0.03	a)
XS2122377281	0.1250 % LFBANK 0 1/8 02/19/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2122485845	0.5000 % DOW 0 1/2 03/15/27	600	0	0	600 EUR	91.10%	546'624.00	0.08	a)
XS2122486066	1.1250 % DOW 1 1/8 03/15/32	500	0	0	500 EUR	81.93%	409'660.00	0.06	a)
XS2122933695	1.8750 % DOW 1 7/8 03/15/40	200	0	0	200 EUR	75.51%	151'022.00	0.02	a)
XS2123320033	0.3890 % JPM 0.389 02/24/28 EMTN	0	400	0	400 EUR	90.58%	362'320.00	0.05	a)
XS2123970167	0.2500 % VFC 0 1/4 02/25/28	200	0	0	200 EUR	83.68%	167'352.00	0.02	a)
XS2123970241	0.6250 % VFC 0 5/8 02/25/32	150	0	0	150 EUR	70.86%	106'287.00	0.01	a)
XS2125145867	0.8500 % GM 0.85 02/26/26	200	0	0	200 EUR	94.42%	188'844.00	0.03	a)
XS2125426796	0.3750 % DSVDC 0 3/8 02/26/27	150	0	0	150 EUR	91.04%	136'564.50	0.02	a)
XS2125914593	1.2500 % ABBV 1 1/4 06/01/24	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2125914916	2.1250 % ABBV 2 1/8 06/01/29	250	0	0	250 EUR	93.64%	234'087.50	0.03	a)
XS2126161681XXX	0.0000 % RELN 0 03/18/24	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2126161764	0.5000 % RELN 0 1/2 03/10/28	300	0	0	300 EUR	89.23%	267'696.00	0.04	a)
XS2126162069	0.8750 % RELN 0 7/8 03/10/32	200	0	0	200 EUR	82.02%	164'036.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2126170161	1.6250 % GIVNVX 1 5/8 04/22/32	150	0	0	150 EUR	86.51%	129'759.00	0.02	a)
XS2128498636	2.0000 % LIGHT 2 05/11/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2128499105	2.3750 % LIGHT 2 3/8 05/11/27	200	0	0	200 EUR	95.09%	190'172.00	0.03	a)
XS2133071774	0.6250 % CARLB 0 5/8 03/09/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	84.56%	211'395.00	0.03	a)
XS2135797202	1.8760 % BPLN 1.876 04/07/24	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2135799679	2.5190 % BPLN 2.519 04/07/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	96.48%	241'190.00	0.03	a)
XS2135801160	2.8220 % BPLN 2.822 04/07/32	400	0	0	400 EUR	94.32%	377'284.00	0.05	a)
XS2147133495	1.2500 % UNANA 1 1/4 03/25/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.46%	194'924.00	0.03	a)
XS2147133578	1.7500 % UNANA 1 3/4 03/25/30	300	0	0	300 EUR	91.91%	275'715.00	0.04	a)
XS2147889427	1.8750 % DGELN 1 7/8 03/27/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.70%	191'396.00	0.03	a)
XS2147889690	2.5000 % DGELN 2 1/2 03/27/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.35%	280'035.00	0.04	a)
XS2147977636	2.2500 % HEIANA 2 1/4 03/30/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	93.84%	234'592.50	0.03	a)
XS2147995299	2.1000 % DHR 2.1 09/30/26	0	300	0	300 EUR	96.62%	289'860.00	0.04	a)
XS2147995372	2.5000 % DHR 2 1/2 03/30/30	0	200	0	200 EUR	95.01%	190'010.00	0.03	a)
XS2148370211	3.6480 % BAC 3.648 03/31/29 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2148372696	1.1250 % NESNVX 1 1/8 04/01/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.64%	191'278.00	0.03	a)
XS2148390755	1.5000 % NESNVX 1 1/2 04/01/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	90.89%	227'222.50	0.03	a)
XS2148623106	3.5000 % LLOYDS 3 1/2 04/01/26 EMTN	350	0	0	350 EUR	99.46%	348'103.00	0.05	a)
XS2149207354	3.3750 % GS 3 3/8 03/27/25	605	0	0	605 EUR	99.53%	602'144.40	0.08	a)
XS2149280948	2.0000 % BERTEL 2 04/01/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.58%	189'150.00	0.03	a)
XS2149379211	2.0000 % PHIANA 2 03/30/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.29%	178'572.00	0.02	a)
XS2150006133	1.3750 % DE 1 3/8 04/02/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2150006307	1.8500 % DE 1.85 04/02/28	150	0	0	150 EUR	95.22%	142'828.50	0.02	a)
XS2150006562	2.2000 % DE 2.2 04/02/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.26%	184'522.00	0.03	a)
XS2150006646	2.7500 % NWG 2 3/4 04/02/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.97%	296'907.00	0.04	a)
XS2150054026	3.3750 % BACR 3 3/8 04/02/25 EMTN	650	0	650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2151059206	2.3750 % MNDILN 2 3/8 04/01/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.38%	190'758.00	0.03	a)
XS2151069775	2.3750 % LLOYDS 2 3/8 04/09/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.41%	243'530.00	0.03	a)
XS2152061904	3.3750 % VW 3 3/8 04/06/28 EMTN	250	250	250	250 EUR	99.26%	248'140.00	0.03	a)
XS2152062209	3.0000 % VW 3 04/06/25 EMTN	250	200	250	200 EUR	99.23%	198'454.00	0.03	a)
XS2152329053	1.6250 % FREGR 1 5/8 10/08/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.22%	186'430.00	0.03	a)
XS2152883406	3.0000 % TCLAU 3 04/08/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.20%	288'594.00	0.04	a)
XS2152902719	0.7970 % CHGRID 0.797 08/05/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	92.67%	231'677.50	0.03	a)
XS2152935214	1.3030 % CHGRID 1.303 08/05/32 EMTN	150	0	0	150 EUR	81.76%	122'632.50	0.02	a)
XS2153405118	0.8750 % IBESM 0 7/8 06/16/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.58%	193'156.00	0.03	a)
XS2153406868	1.4910 % TTEFP 1.491 04/08/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	94.30%	377'180.00	0.05	a)
XS2153409029	1.9940 % TTEFP 1.994 04/08/32 EMTN	400	0	0	400 EUR	89.63%	358'528.00	0.05	a)
XS2153459123	2.0000 % LUCSHI 2 04/06/29 EMTN	150	150	0	300 EUR	93.11%	279'324.00	0.04	a)
XS2154325489	3.3750 % SYNNVX 3 3/8 04/16/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.05%	294'150.00	0.04	a)
XS2154347293	1.5000 % OMVAV 1 1/2 04/09/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2154347707	2.0000 % OMVAV 2 04/09/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.20%	190'406.00	0.03	a)
XS2154348424	2.3750 % OMVAV 2 3/8 04/09/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.15%	279'450.00	0.04	a)
XS2154418144	1.1250 % RDSALN 1 1/8 04/07/24 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2154418730	1.5000 % RDSALN 1 1/2 04/07/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.78%	92'775.00	0.01	a)
XS2154419118	1.8750 % RDSALN 1 7/8 04/07/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.73%	266'196.00	0.04	a)
XS2155365641	3.5000 % LPTY 3 1/2 04/09/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	99.54%	199'082.00	0.03	a)
XS2156236452	2.2800 % TOYOTA 2.28 10/21/27 EMTN	0	150	0	150 EUR	95.95%	143'922.00	0.02	a)
XS2156510021	1.0000 % SHBASS 1 04/15/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	96.94%	193'884.00	0.03	a)
XS2156581394	2.0000 % REPSM 2 12/15/25	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2156583259	2.6250 % REPSM 2 5/8 04/15/30 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2156598281	1.6250 % AKZANA 1 5/8 04/14/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	88.59%	88'589.00	0.01	a)
XS2156607702	0.6250 % ENBW 0 5/8 04/17/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.58%	193'154.00	0.03	a)
XS2156787090	1.2500 % SSELN 1 1/4 04/16/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.27%	194'542.00	0.03	a)
XS2156787173	1.7500 % SSELN 1 3/4 04/16/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	89.97%	224'925.00	0.03	a)
XS2159791990	1.9500 % HNDA 1.95 10/18/24	200	0	0	200 EUR	98.88%	197'756.00	0.03	a)
XS2160857798	1.0000 % TLSAU 1 04/23/30	0	200	0	200 EUR	87.07%	174'134.00	0.02	a)
XS2162004209	0.5000 % ONTTFT 0 1/2 05/06/25	500	0	0	500 EUR	96.35%	481'760.00	0.07	a)
XS2163320679	0.7500 % SWFP 0 3/4 04/27/25	200	0	0	200 EUR	96.60%	193'204.00	0.03	a)
XS2163333656	1.0000 % SWFP 1 04/27/29	300	0	0	300 EUR	89.77%	269'310.00	0.04	a)
XS2164646304	2.0000 % APAAU 2 07/15/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	88.73%	88'727.00	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2166122304	0.5000 % APD 0 1/2 05/05/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.52%	177'048.00	0.02	a)
XS2166219720	0.6250 % ASML 0 5/8 05/07/29	0	400	0	400 EUR	87.96%	351'848.00	0.05	a)
XS2166312939	0.4500 % OMERFT 0.45 05/13/25 REGS	250	0	0	250 EUR	96.30%	240'745.00	0.03	a)
XS2166619663	1.3750 % FIRMEN 1 3/8 10/30/26	200	0	0	200 EUR	94.73%	189'462.00	0.03	a)
XS2166619820	1.7500 % FIRMEN 1 3/4 04/30/30	200	0	0	200 EUR	90.43%	180'864.00	0.02	a)
XS2166754957	1.3750 % SLB 1 3/8 10/28/26	0	300	0	300 EUR	94.67%	283'998.00	0.04	a)
XS2166755509	2.0000 % SLB 2 05/06/32	0	350	0	350 EUR	89.35%	312'714.50	0.04	a)
XS2167002521	0.7500 % SWEDA 0 3/4 05/05/25 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.45%	289'353.00	0.04	a)
XS2167003685	1.2500 % C 1 1/4 07/06/26 EMTN	600	0	0	600 EUR	96.52%	579'114.00	0.08	a)
XS2167007249	1.3380 % WFC 1.338 05/04/25 EMTN	800	0	800	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2167007918	1.7410 % WFC 1.741 05/04/30 EMTN	650	0	650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2168285000	0.8750 % RABOBK 0 7/8 05/05/28 GMTN	300	0	0	300 EUR	91.24%	273'714.00	0.04	a)
XS2168307333	0.7500 % APH 0 3/4 05/04/26	150	0	0	150 EUR	93.94%	140'913.00	0.02	a)
XS2168478068	1.2500 % CRHID 1 1/4 11/05/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	94.17%	141'249.00	0.02	a)
XS2168625460	0.2500 % PEP 0 1/4 05/06/24	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2168625544	0.5000 % PEP 0 1/2 05/06/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.48%	268'440.00	0.04	a)
XS2168629967	1.2500 % HEIANA 1 1/4 05/07/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	82.06%	164'116.00	0.02	a)
XS2168630205	1.7500 % HEIANA 1 3/4 05/07/40 EMTN	250	0	0	250 EUR	77.65%	194'125.00	0.03	a)
XS2168647357	1.3750 % SANTAN 1 3/8 01/05/26 EMTN	500	0	0	500 EUR	95.61%	478'055.00	0.07	a)
XS2169281487	1.6250 % CRHID 1 5/8 05/05/30	250	0	0	250 EUR	89.73%	224'315.00	0.03	a)
XS2170362672	0.1250 % NESNVX 0 1/8 11/12/27 EMTN	200	100	0	300 EUR	89.77%	269'301.00	0.04	a)
XS2170362912	0.3750 % NESNVX 0 3/8 05/12/32	250	0	0	250 EUR	80.32%	200'797.50	0.03	a)
XS2170384130	0.5000 % RDSALN 0 1/2 05/11/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2170386853	1.2500 % RDSALN 1 1/4 11/11/32 EMTN	150	300	0	450 EUR	83.37%	375'142.50	0.05	a)
XS2170736180	0.7500 % CFRVX 0 3/4 05/26/28	200	0	0	200 EUR	90.19%	180'378.00	0.02	a)
XS2170736263	1.1250 % CFRVX 1 1/8 05/26/32	300	0	0	300 EUR	84.12%	252'369.00	0.03	a)
XS2171210862	0.3750 % HESLAN 0 3/8 05/12/25 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2171253912	0.5000 % OPBANK 0 1/2 08/12/25 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2171316859	0.6250 % DANBNK 0 5/8 05/26/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	96.18%	240'445.00	0.03	a)
XS2171872570	3.1250 % NOKIA 3 1/8 05/15/28 EMTN	0	150	0	150 EUR	96.63%	144'951.00	0.02	a)
XS2171874519	0.5000 % NDAFH 0 1/2 05/14/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	91.47%	274'404.00	0.04	a)
XS2171875839	2.7500 % CPIPGR 2 3/4 05/12/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.38%	178'750.00	0.02	a)
XS2175848170	1.6250 % VLVY 1 5/8 05/26/25 EMTN	150	0	0	150 EUR	97.35%	146'017.50	0.02	a)
XS2175967343	1.5000 % ACHMEA 1 1/2 05/26/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	93.39%	280'158.00	0.04	a)
XS2176534795	0.7500 % WURTH 0 3/4 11/22/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2176558620	1.5000 % BERTEL 1 1/2 05/15/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.63%	177'260.00	0.02	a)
XS2176560444	1.3000 % VZ 1.3 05/18/33	0	400	0	400 EUR	80.96%	323'840.00	0.04	a)
XS2176561095	1.8500 % VZ 1.85 05/18/40	0	300	0	300 EUR	75.34%	226'005.00	0.03	a)
XS2176562812	2.3750 % WPPLN 2 3/8 05/19/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.38%	192'750.00	0.03	a)
XS2176569312	1.6180 % TTEFP 1.618 05/18/40 EMTN	300	0	0	300 EUR	75.24%	225'714.00	0.03	a)
XS2176605306	0.9520 % TTEFP 0.952 05/18/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.41%	168'824.00	0.02	a)
XS2176621170	2.1250 % INTNED 2 1/8 05/26/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.25%	285'750.00	0.04	a)
XS2176686546	0.4500 % UBS 0.45 05/19/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.06%	96'055.00	0.01	a)
XS2176715667	0.3750 % SAPGR 0 3/8 05/18/29	200	0	0	200 EUR	86.84%	173'686.00	0.02	a)
XS2176783319	1.2500 % ENIIM 1 1/4 05/18/26 EMTN	0	400	0	400 EUR	95.00%	379'996.00	0.05	a)
XS2176785447	2.0000 % ENIIM 2 05/18/31 EMTN	0	300	0	300 EUR	89.13%	267'399.00	0.04	a)
XS2177013252	0.3750 % RKTLN 0 3/8 05/19/26 REGS	200	0	0	200 EUR	93.46%	186'914.00	0.03	a)
XS2177013765	0.7500 % RKTLN 0 3/4 05/19/30 REGS	300	0	0	300 EUR	85.44%	256'314.00	0.04	a)
XS2177021271	0.2500 % LIN 0 1/4 05/19/27	0	100	0	100 EUR	90.75%	90'745.00	0.01	a)
XS2177021602	0.5500 % LIN 0.55 05/19/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	79.65%	159'290.00	0.02	a)
XS2177122541	0.3750 % DHLGR 0 3/8 05/20/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.56%	187'124.00	0.03	a)
XS2177122624	0.7500 % DHLGR 0 3/4 05/20/29 EMTN	100	0	0	100 EUR	88.81%	88'807.00	0.01	a)
XS2177122897	1.0000 % DHLGR 1 05/20/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	85.89%	257'655.00	0.04	a)
XS2177441990	1.2010 % TELEFO 1.201 08/21/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.40%	277'206.00	0.04	a)
XS2177442295	1.8070 % TELEFO 1.807 05/21/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	86.47%	259'395.00	0.04	a)
XS2178457425	1.6250 % CFRVX 1 5/8 05/26/40	0	250	0	250 EUR	77.44%	193'605.00	0.03	a)
XS2178586157	2.5000 % CONGR 2 1/2 08/27/26 EMTN	0	150	0	150 EUR	97.64%	146'454.00	0.02	a)
XS2178769076	1.0000 % FMEGR 1 05/29/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.79%	187'572.00	0.03	a)
XS2178769159	1.5000 % FMEGR 1 1/2 05/29/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.10%	172'200.00	0.02	a)
XS2178833427	0.7500 % EQNR 0 3/4 05/22/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.26%	235'637.50	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2178833690	1.3750 % EQNR 1 3/8 05/22/32 EMTN	350	0	0	350 EUR	85.52%	299'309.50	0.04	a)
XS2178833773	3.8750 % STLA 3 7/8 01/05/26	250	0	0	250 EUR	100.11%	250'282.50	0.03	a)
XS2178957077	1.8750 % REDEXS 1 7/8 05/28/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.33%	194'652.00	0.03	a)
XS2179037697	2.1250 % ISPIM 2 1/8 05/26/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.89%	244'730.00	0.03	a)
XS2179959817	1.8750 % VVOYHT 1 7/8 05/27/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	90.80%	226'990.00	0.03	a)
XS2180007549	1.6000 % T 1.6 05/19/28	450	200	0	650 EUR	92.39%	600'528.50	0.08	a)
XS2180008513	2.0500 % T 2.05 05/19/32	350	0	0	350 EUR	87.94%	307'783.00	0.04	a)
XS2180009081	2.6000 % T 2.6 05/19/38	150	0	0	150 EUR	83.97%	125'958.00	0.02	a)
XS2181959110	2.7140 % SRENVX 2.714 06/04/52 EMTN	200	100	0	300 EUR	86.17%	258'498.00	0.04	a)
XS2182054887	0.3750 % SIEGR 0 3/8 06/05/26 EMTN	200	100	0	300 EUR	93.52%	280'572.00	0.04	a)
XS2182055009	3.7500 % FIRMEN 3 3/4 PERP	0	300	0	300 EUR	98.00%	294'000.00	0.04	a)
XS2182055181	0.2500 % SIEGR 0 1/4 06/05/24 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2182067350	2.2500 % SCANIA 2 1/4 06/03/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	97.79%	97'790.00	0.01	a)
XS2182404298	0.7500 % BBVASM 0 3/4 06/04/25 GMTN	300	0	0	300 EUR	96.40%	289'212.00	0.04	a)
XS2183818637	2.5000 % STANLN 2 1/2 09/09/30	300	0	0	300 EUR	97.18%	291'540.00	0.04	a)
XS2185867673	1.6250 % OPBANK 1 5/8 06/09/30	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2185997884	3.7500 % REPSM 3 3/4 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2186001314	4.2470 % REPSM 4.247 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2187689034	3.5000 % VW 3 1/2 PERP	400	200	400	200 EUR	97.33%	194'650.00	0.03	a)
XS2187689380	3.8750 % VW 3 7/8 PERP	300	400	300	400 EUR	90.40%	361'592.00	0.05	a)
XS2188805688	0.8750 % COVEGR 0 7/8 02/03/26 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2188805845	1.3750 % COVEGR 1 3/8 06/12/30 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2189594315	2.1250 % SIGCBL 2 1/8 06/18/25 REGS	200	0	0	200 EUR	97.60%	195'202.00	0.03	a)
XS2189613982	0.7500 % OMVAV 0 3/4 06/16/30 EMTN	150	0	0	150 EUR	85.32%	127'978.50	0.02	a)
XS2189786226	2.8750 % RBAV 2 7/8 06/18/32	100	0	0	100 EUR	90.74%	90'743.00	0.01	a)
XS2189931335	0.5500 % MET 0.55 06/16/27 GMTN	150	0	0	150 EUR	90.70%	136'047.00	0.02	a)
XS2189970317	1.8750 % ZURNVX 1 7/8 09/17/50 EMTN	100	100	0	200 EUR	86.28%	172'556.00	0.02	a)
XS2190134184	1.2500 % UCIGIM 1 1/4 06/16/26 EMTN	450	0	0	450 EUR	96.59%	434'641.50	0.06	a)
XS2190256706	0.7500 % SRGIM 0 3/4 06/17/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	83.75%	167'500.00	0.02	a)
XS2191362859	1.2500 % DLR 1 1/4 02/01/31	200	0	0	200 EUR	82.14%	164'284.00	0.02	a)
XS2191509038	0.3750 % CARLB 0 3/8 06/30/27	100	0	0	100 EUR	90.27%	90'267.00	0.01	a)
XS2192431380	0.2500 % IGIM 0 1/4 06/24/25 EMTN	150	0	0	150 EUR	95.37%	143'050.50	0.02	a)
XS2193661324	3.2500 % BPLN 3 1/4 PERP	700	0	0	700 EUR	96.38%	674'625.00	0.09	a)
XS2193662728	3.6250 % BPLN 3 5/8 PERP	650	0	0	650 EUR	93.38%	606'937.50	0.08	a)
XS2193669657	1.1250 % AMCR 1 1/8 06/23/27	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2193733503	1.0000 % CZGRID 1 07/16/27	200	0	0	200 EUR	92.15%	184'294.00	0.03	a)
XS2193734733	1.6250 % DELL 1 5/8 06/24/24	200	0	0	200 EUR	99.28%	198'564.00	0.03	a)
XS2193956716	0.3750 % HYN0E 0 3/8 06/25/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.69%	197'376.00	0.03	a)
XS2193978363	0.2500 % DSM 0 1/4 06/23/28	150	0	0	150 EUR	88.30%	132'451.50	0.02	a)
XS2193979254	0.6250 % DSM 0 5/8 06/23/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.83%	161'664.00	0.02	a)
XS2193982803	1.3620 % VTRS 1.362 06/23/27	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2193983108	1.9080 % VTRS 1.908 06/23/32	400	0	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2194192527	2.0000 % IFXGR 2 06/24/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.11%	178'220.00	0.02	a)
XS2194283672	1.1250 % IFXGR 1 1/8 06/24/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	95.04%	285'105.00	0.04	a)
XS2194283839	1.6250 % IFXGR 1 5/8 06/24/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.15%	182'290.00	0.03	a)
XS2194370727	1.1250 % SANTAN 1 1/8 06/23/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.29%	184'586.00	0.03	a)
XS2195092601	2.2500 % ABESM 2 1/4 03/29/29 EMTN	200	200	0	400 EUR	92.06%	368'240.00	0.05	a)
XS2196328608	1.8750 % ENBW 1 7/8 06/29/2080	200	0	0	200 EUR	93.79%	187'576.00	0.03	a)
XS2197076651	2.7500 % HELNSW 2 3/4 09/30/41	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2197342129	0.1250 % OPBANK 0 1/8 07/01/24 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2197348324	0.7500 % TACHEM 0 3/4 07/09/27	250	0	0	250 EUR	91.19%	227'980.00	0.03	a)
XS2197348597	1.0000 % TACHEM 1 07/09/29	250	0	0	250 EUR	87.66%	219'140.00	0.03	a)
XS2197349645	1.3750 % TACHEM 1 3/8 07/09/32	300	0	0	300 EUR	83.44%	250'320.00	0.03	a)
XS2197356186	1.0000 % IREIM 1 07/01/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	84.38%	168'754.00	0.02	a)
XS2197673747	3.0000 % MTXGR 3 07/01/25	150	0	0	150 EUR	98.79%	148'186.50	0.02	a)
XS2197675288	1.8640 % TELEFO 1.864 07/13/40 EMTN	200	0	0	200 EUR	74.50%	149'006.00	0.02	a)
XS2197770279	1.7500 % BRTFOD 1 3/4 07/22/25	250	0	0	250 EUR	95.01%	237'530.00	0.03	a)
XS2198580271	0.7500 % WKLNA 0 3/4 07/03/30	250	0	0	250 EUR	85.13%	212'820.00	0.03	a)
XS2198582301	2.0000 % TACHEM 2 07/09/40	274	0	0	274 EUR	76.81%	210'451.18	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2199265617	0.3750 % BAYNGR 0 3/8 07/06/24	300	0	0	300 EUR	98.82%	296'469.00	0.04	a)
XS2199266003	0.7500 % BAYNGR 0 3/4 01/06/27	400	0	0	400 EUR	91.21%	364'824.00	0.05	a)
XS2199266268	1.1250 % BAYNGR 1 1/8 01/06/30	300	0	0	300 EUR	83.08%	249'231.00	0.03	a)
XS2199266698	1.3750 % BAYNGR 1 3/8 07/06/32	400	0	0	400 EUR	78.56%	314'232.00	0.04	a)
XS2199351375	4.5000 % STLA 4 1/2 07/07/28	500	0	0	500 EUR	103.20%	516'010.00	0.07	a)
XS2199604096	1.3750 % UQA 1 3/8 07/09/30	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2200150766	0.7500 % CABKSM 0 3/4 07/10/26 EMTN	500	0	0	500 EUR	95.94%	479'710.00	0.07	a)
XS2200175839	1.5000 % LOGICR 1 1/2 07/13/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	93.48%	140'214.00	0.02	a)
XS2200513070	0.8230 % NGGLN 0.823 07/07/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	78.97%	236'916.00	0.03	a)
XS2201946634	2.3750 % MRLSM 2 3/8 07/13/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	95.31%	190'610.00	0.03	a)
XS2202744384	2.2500 % CEPESA 2 1/4 02/13/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.78%	193'566.00	0.03	a)
XS2202902636	1.7500 % DEVOBA 1 3/4 10/22/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.86%	94'858.00	0.01	a)
XS2203802462	3.3750 % NEPSJ 3 3/8 07/14/27	150	0	0	150 EUR	95.81%	143'709.00	0.02	a)
XS2203996132	1.0000 % SWFP 1 07/17/28	150	0	0	150 EUR	90.83%	136'245.00	0.02	a)
XS2206379567	2.2500 % AMCOSP 2 1/4 07/17/27 GMTN	250	0	0	250 EUR	94.01%	235'020.00	0.03	a)
XS2207430120	2.3740 % TENN 2.374 PERP	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2207976783	2.2000 % UCGIM 2.2 07/22/27 EMTN	350	0	0	350 EUR	95.87%	335'538.00	0.05	a)
XS2209023402	0.7500 % TRNIM 0 3/4 07/24/32	250	0	0	250 EUR	79.53%	198'822.50	0.03	a)
XS2211183244	1.5390 % PRXNA 1.539 08/03/28 REGS	0	150	0	150 EUR	87.70%	131'547.00	0.02	a)
XS2211183756	2.0310 % PRXNA 2.031 08/03/32 REGS	0	200	0	200 EUR	77.81%	155'628.00	0.02	a)
XS2218405772	1.6250 % MRKGR 1 5/8 09/09/2080	100	200	0	300 EUR	93.25%	279'750.00	0.04	a)
XS2221845683	1.2500 % MUNRE 1 1/4 05/26/41	200	0	0	200 EUR	81.39%	162'780.00	0.02	a)
XS2224439385	2.5000 % OMVAV 2 1/2 PERP	200	0	0	200 EUR	94.50%	189'000.00	0.03	a)
XS2224439971	2.8750 % OMVAV 2 7/8 PERP	200	0	0	200 EUR	89.88%	179'750.00	0.02	a)
XS2224621420	0.6250 % ADSGR 0 5/8 09/10/35	200	0	0	200 EUR	74.07%	148'146.00	0.02	a)
XS2224632971	2.0000 % TTEFP 2 PERP	250	0	0	250 EUR	84.88%	212'187.50	0.03	a)
XS2225207468	1.3750 % HEIBOS 1 3/8 03/03/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	85.01%	212'527.50	0.03	a)
XS2225890537	1.1250 % ATH 1 1/8 09/02/25 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2225893630	1.5000 % DANBNK 1 1/2 09/02/30 EMTN	150	0	0	150 EUR	95.43%	143'137.50	0.02	a)
XS2226645278	2.5000 % SAMPFH 2 1/2 09/03/52 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2227050023	0.3750 % LUCSHI 0 3/8 09/08/27 EMTN	200	0	100	100 EUR	90.12%	90'118.00	0.01	a)
XS2227050379	0.8750 % LUCSHI 0 7/8 09/08/32 EMTN	250	0	0	250 EUR	80.55%	201'362.50	0.03	a)
XS2227196404	1.0000 % BACRED 1 09/08/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2227905903	0.5000 % AMT 0 1/2 01/15/28	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2227906208	1.0000 % AMT 1 01/15/32	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2228245838	1.1250 % SABSM 1 1/8 03/11/27	200	0	0	200 EUR	94.67%	189'336.00	0.03	a)
XS2228260043	2.8750 % RYAI 2 7/8 09/15/25 EMTN	170	0	170	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2228683277	2.6520 % NSANY 2.652 03/17/26 REGS	200	0	0	200 EUR	96.86%	193'716.00	0.03	a)
XS2228683350	3.2010 % NSANY 3.201 09/17/28 REGS	250	0	0	250 EUR	96.03%	240'077.50	0.03	a)
XS2228897158	1.0000 % AKFAST 1 01/17/28 EMTN	150	150	150	150 EUR	86.82%	130'222.50	0.02	a)
XS2229470146	0.8750 % KPN 0 7/8 12/14/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	79.14%	158'276.00	0.02	a)
XS2229875989	3.2500 % F 3 1/4 09/15/25 EMTN	0	300	0	300 EUR	98.49%	295'479.00	0.04	a)
XS2230399441	2.8750 % AIB 2 7/8 05/30/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.83%	191'654.00	0.03	a)
XS2230884657	0.1250 % VLVY 0 1/8 09/17/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.99%	195'980.00	0.03	a)
XS2231165668	1.5000 % BEVLUX 1 1/2 09/16/27	200	0	0	200 EUR	91.96%	183'912.00	0.03	a)
XS2231183646	1.6250 % HITTFF 1 5/8 09/18/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.72%	266'157.00	0.04	a)
XS2231267829	0.6250 % YBS 0 5/8 09/21/25	150	0	0	150 EUR	95.21%	142'821.00	0.02	a)
XS2231330965	0.3750 % JCI 0 3/8 09/15/27	200	0	0	200 EUR	89.59%	179'170.00	0.02	a)
XS2231331344	1.0000 % JCI 1 09/15/32	200	0	0	200 EUR	81.65%	163'306.00	0.02	a)
XS2232027727	1.6250 % KGXGR 1 5/8 09/24/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	96.08%	192'158.00	0.03	a)
XS2232115423	1.0000 % DLR 1 01/15/32	400	0	0	400 EUR	78.38%	313'516.00	0.04	a)
XS2233154538	0.1250 % KO 0 1/8 03/15/29	200	0	0	200 EUR	85.63%	171'250.00	0.02	a)
XS2233155261	0.3750 % KO 0 3/8 03/15/33	150	0	0	150 EUR	76.93%	115'396.50	0.02	a)
XS2233155345	0.8000 % KO 0.8 03/15/40	150	0	0	150 EUR	67.31%	100'965.00	0.01	a)
XS2234567233	0.8750 % VW 0 7/8 09/22/28 EMTN	300	300	300	300 EUR	88.01%	264'021.00	0.04	a)
XS2234567662	1.2500 % VW 1 1/4 09/23/32 EMTN	100	100	100	100 EUR	81.78%	81'777.00	0.01	a)
XS2234579675	0.3030 % SUMIBK 0.303 10/28/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	88.78%	177'552.00	0.02	a)
XS2235986929	0.0000 % MDLZ 0 09/22/26 REGS	0	200	0	200 EUR	91.51%	183'024.00	0.03	a)
XS2235987224	0.3750 % MDLZ 0 3/8 09/22/29 REGS	0	250	0	250 EUR	84.30%	210'760.00	0.03	a)
XS2235996217	0.0000 % NOVNVX 0 09/23/28	0	200	0	200 EUR	86.51%	173'022.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2235996217XXX	0.0000 % *RETIRED*	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2236363573	1.8750 % AMSSM 1 7/8 09/24/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	93.73%	374'908.00	0.05 a)	
XS2237447961	1.1250 % FREGR 1 1/8 01/28/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	79.16%	79'160.00	0.01 a)	
XS2237901355	0.3750 % TRNIM 0 3/8 09/25/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.11%	162'216.00	0.02 a)	
XS2238783422	2.3750 % JAPTOB 2 3/8 04/07/2081	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2238783778	2.8750 % JAPTOB 2 7/8 10/07/2083	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2238787415	0.0000 % MDT 0 10/15/25	200	0	0	200 EUR	94.23%	188'464.00	0.03 a)	
XS2238789460	0.3750 % MDT 0 3/8 10/15/28	200	0	0	200 EUR	87.28%	174'554.00	0.02 a)	
XS2238792175	0.7500 % MDT 0 3/4 10/15/32	300	0	0	300 EUR	79.87%	239'619.00	0.03 a)	
XS2238792332	1.3750 % MDT 1 3/8 10/15/40	400	0	0	400 EUR	70.97%	283'892.00	0.04 a)	
XS2238792688	1.6250 % MDT 1 5/8 10/15/50	200	0	0	200 EUR	65.69%	131'382.00	0.02 a)	
XS2240063730	0.1250 % DGELN 0 1/8 09/28/28 EMTN	150	0	0	150 EUR	86.74%	130'110.00	0.02 a)	
XS2240494471	1.6250 % IHGLN 1 5/8 10/08/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.58%	197'150.00	0.03 a)	
XS2240505268	0.0000 % ADSGR 0 10/05/28	200	0	0	200 EUR	86.53%	173'050.00	0.02 a)	
XS2240507801	2.1250 % INFLN 2 1/8 10/06/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.07%	194'130.00	0.03 a)	
XS2241387096	0.6930 % MIZUHO 0.693 10/07/30 EMTN	0	250	0	250 EUR	81.89%	204'715.00	0.03 a)	
XS2241387252	0.2140 % MIZUHO 0.214 10/07/25 EMTN	0	100	0	100 EUR	94.75%	94'746.00	0.01 a)	
XS2241825111	1.3750 % GSWITC 1 3/8 10/07/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	90.98%	227'455.00	0.03 a)	
XS2242633258	0.4000 % PEP 0.4 10/09/32	300	0	0	300 EUR	78.20%	234'600.00	0.03 a)	
XS2242633332	1.0500 % PEP 1.05 10/09/50	200	0	0	200 EUR	61.05%	122'096.00	0.02 a)	
XS2242728041	0.2500 % ENBW 0 1/4 10/19/30	200	0	0	200 EUR	81.72%	163'444.00	0.02 a)	
XS2242747181	0.1550 % ASABRE 0.155 10/23/24	200	0	0	200 EUR	97.62%	195'248.00	0.03 a)	
XS2242747348	0.5410 % ASABRE 0.541 10/23/28	250	0	0	250 EUR	87.16%	217'890.00	0.03 a)	
XS2242921711	0.5000 % RTOLN 0 1/2 10/14/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.88%	173'768.00	0.02 a)	
XS2242929532	2.6250 % ENIIM 2 5/8 PERP NC5	0	450	0	450 EUR	96.13%	432'562.50	0.06 a)	
XS2242931603	3.3750 % ENIIM 3 3/8 PERP NC9	0	450	0	450 EUR	91.50%	411'750.00	0.06 a)	
XS2242979719	1.5000 % HTHROW 1 1/2 10/12/25	250	0	0	250 EUR	96.11%	240'267.50	0.03 a)	
XS2243299463	0.8750 % LUNDC 0 7/8 10/14/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.31%	178'622.00	0.02 a)	
XS2244415175	1.6010 % DAAFIN 1.601 11/05/32	200	0	0	200 EUR	84.53%	169'050.00	0.02 a)	
XS2244941063	1.8740 % IBESM 1.874 PERP NC5	400	0	0	400 EUR	94.55%	378'188.00	0.05 a)	
XS2244941147	2.2500 % IBESM 2 1/4 PERP NC8	300	0	0	300 EUR	88.02%	264'072.00	0.04 a)	
XS2247936342	1.6250 % SANTAN 1 5/8 10/22/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	84.91%	254'715.00	0.03 a)	
XS2248451978	0.6540 % BAC 0.654 10/26/31 EMTN	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2250008245	0.4950 % MS 0.495 10/26/29	500	0	0	500 EUR	85.67%	428'330.00	0.06 a)	
XS2250024010	0.3750 % INVSA 0 3/8 10/29/35 EMTN	0	250	0	250 EUR	70.54%	176'352.50	0.02 a)	
XS2250376477	0.6250 % AEMSPA 0 5/8 10/28/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	75.22%	75'224.00	0.01 a)	
XS2251233651	1.1250 % AKFAST 1 1/8 01/11/29 EMTN	300	300	300	300 EUR	83.59%	250'755.00	0.03 a)	
XS2251626896	0.3750 % ENGSM 0 3/8 11/05/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	76.47%	76'465.00	0.01 a)	
XS2251736646	0.3090 % HSBC 0.309 11/13/26 GEN	200	0	0	200 EUR	94.22%	188'446.00	0.03 a)	
XS2251736992	0.7700 % HSBC 0.77 11/13/31	250	0	0	250 EUR	82.59%	206'475.00	0.03 a)	
XS2257961818	0.1250 % UPMFH 0 1/8 11/19/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	85.60%	213'992.50	0.03 a)	
XS2258389415	0.1000 % OPBANK 0.1 11/16/27 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2258452478	0.2500 % INTNED 0 1/4 02/18/29	400	0	0	400 EUR	86.59%	346'364.00	0.05 a)	
XS2258971071	0.3750 % CABKSM 0 3/8 11/18/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.07%	282'210.00	0.04 a)	
XS2259210677	0.0500 % ONTFTT 0.05 11/25/30 GMTN	300	0	0	300 EUR	80.64%	241'905.00	0.03 a)	
XS2262065159	0.1250 % TENN 0 1/8 11/30/32 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2262065233	0.5000 % TENN 0 1/2 11/30/40 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2263684776	0.0000 % NESNVX 0 03/03/33 EMTN	150	0	0	150 EUR	75.14%	112'707.00	0.02 a)	
XS2263684933	0.3750 % NESNVX 0 3/8 12/03/40	200	0	0	200 EUR	62.91%	125'810.00	0.02 a)	
XS2264074647	2.3750 % LOUDRE 2 3/8 11/27/25	250	0	0	250 EUR	97.24%	243'090.00	0.03 a)	
XS2264161964	0.1250 % TELIAS 0 1/8 11/27/30	150	100	0	250 EUR	80.34%	200'850.00	0.03 a)	
XS2264193819	0.8720 % NGGLN 0.872 11/26/40 EMTN	200	0	0	200 EUR	65.58%	131'158.00	0.02 a)	
XS2264977146	0.2000 % CCEP 0.2 12/02/28	250	0	0	250 EUR	85.61%	214'017.50	0.03 a)	
XS2265360359	0.6250 % STERV 0 5/8 12/02/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.25%	160'504.00	0.02 a)	
XS2265369657	3.0000 % LHAGR 3 05/29/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	97.29%	291'876.00	0.04 a)	
XS2265371042	0.3500 % MQGAU 0.35 03/03/28	350	0	0	350 EUR	88.25%	308'861.00	0.04 a)	
XS2265968284	0.0100 % SHBASS 0.01 12/02/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	87.62%	175'240.00	0.02 a)	
XS2265990452	0.2500 % HERIM 0 1/4 12/03/30 EMTN	350	0	0	350 EUR	79.52%	278'309.50	0.04 a)	
XS2267889991	2.0000 % ATOSTR 2 12/04/28	330	0	0	330 EUR	91.66%	302'474.70	0.04 a)	
XS2268340010	0.0000 % SRGIM 0 12/07/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.87%	169'746.00	0.02 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
X52270147924	0.9330 % BPLN 0.933 12/04/40 EMTN	150	0	0	150 EUR	63.50%	95'251.50	0.01	a)
X52270150399	0.0500 % VW 0.05 06/10/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52273810510	0.0000 % ARNDTN 0 07/16/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	85.75%	171'500.00	0.02	a)
X52275029085	0.2500 % IREIM 0 1/4 01/17/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	78.79%	157'574.00	0.02	a)
X52278566299	2.0000 % ATOSTR 2 01/15/30	300	0	0	300 EUR	88.35%	265'035.00	0.04	a)
X52280835260	0.6250 % DLR 0 5/8 07/15/31	200	0	0	200 EUR	77.18%	154'356.00	0.02	a)
X52280845145	0.2000 % BMW 0.2 01/11/33 EMTN	150	0	0	150 EUR	76.19%	114'286.50	0.02	a)
X52280845491	0.0000 % BMW 0 01/11/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.03%	235'082.50	0.03	a)
X52281155254	0.2500 % INTNED 0 1/4 02/01/30	300	0	0	300 EUR	83.56%	250'671.00	0.03	a)
X52281342878	0.0500 % BAYNGR 0.05 01/12/25	400	0	0	400 EUR	96.68%	386'732.00	0.05	a)
X52281343256	0.3750 % BAYNGR 0 3/8 01/12/29	200	0	0	200 EUR	83.70%	167'402.00	0.02	a)
X52281343413	0.6250 % BAYNGR 0 5/8 07/12/31	300	0	0	300 EUR	76.18%	228'525.00	0.03	a)
X52281343686	1.0000 % BAYNGR 1 01/12/36	300	0	0	300 EUR	68.57%	205'701.00	0.03	a)
X52281473111	0.0000 % HEMSOF 0 01/19/28 EMTN	0	150	0	150 EUR	85.43%	128'151.00	0.02	a)
X52281473111XXX	0.0000 % HEMSOF 0 01/19/28 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52282094494	0.2500 % VW 0 1/4 01/12/26 EMTN	200	200	200	200 EUR	93.55%	187'106.00	0.03	a)
X52282095970	0.5000 % VW 0 1/2 01/12/29 EMTN	200	200	200	200 EUR	85.46%	170'918.00	0.02	a)
X52282101539	0.1250 % GYCGR 0 1/8 01/11/28 EMTN	0	400	0	400 EUR	82.53%	330'100.00	0.05	a)
X52282195176	0.6250 % ATH 0 5/8 01/12/28 GMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52282210231	0.2000 % SWEDA 0.2 01/12/28 GMTN	800	0	0	800 EUR	86.84%	694'728.00	0.10	a)
X52286012849	0.8750 % LOGICR 0 7/8 01/14/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	77.56%	155'110.00	0.02	a)
X52286044024	0.5000 % CBREGI 0 1/2 01/27/28	150	0	0	150 EUR	86.38%	129'562.50	0.02	a)
X52286044370	0.0000 % ABBNVX 0 01/19/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	81.96%	245'877.00	0.03	a)
X52286442186	0.6250 % HOLNSW 0 5/8 01/19/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	75.78%	151'550.00	0.02	a)
X52287624584	0.1250 % MOTOPG 0 1/8 07/20/28 EMTN	150	0	0	150 EUR	86.11%	129'157.50	0.02	a)
X52288925568	1.0000 % BALDER 1 01/20/29 EMTN	0	250	0	250 EUR	80.30%	200'755.00	0.03	a)
X52288948859	0.1000 % EOANGR 0.1 12/19/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.79%	175'584.00	0.02	a)
X52289133758	0.8500 % UCGIM 0.85 01/19/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	81.65%	244'941.00	0.03	a)
X52289133915	0.3250 % UCGIM 0.325 01/19/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.81%	281'418.00	0.04	a)
X52289408440	0.1630 % NGGLN 0.163 01/20/28 EMTN	500	0	0	500 EUR	87.24%	436'210.00	0.06	a)
X52289797248	0.9050 % NATUEN 0.905 01/22/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	78.71%	78'714.00	0.01	a)
X52289877941	0.3750 % TSCOLN 0 3/8 07/27/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	84.03%	252'081.00	0.03	a)
X52290544068	1.5000 % CPIPGR 1 1/2 01/27/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	62.75%	125'500.00	0.02	a)
X52290960520	1.6250 % TTEFP 1 5/8 PERP NC7	300	0	0	300 EUR	89.50%	268'500.00	0.04	a)
X52290960876	2.1250 % TTEFP 2 1/8 PERP NC12	500	0	0	500 EUR	80.25%	401'250.00	0.06	a)
X52292263121	0.4970 % MS 0.497 02/07/31	600	0	0	600 EUR	82.12%	492'726.00	0.07	a)
X52292487076	0.2500 % ACEIM 0 1/4 07/28/30 EMTN	0	450	0	450 EUR	80.44%	361'957.50	0.05	a)
X52292547317	0.5790 % FIREIT 0.579 01/29/31 EMTN	150	0	0	150 EUR	80.54%	120'811.50	0.02	a)
X52292954893	0.2500 % GS 0 1/4 01/26/28 EMTN	480	0	0	480 EUR	88.00%	422'404.80	0.06	a)
X52293075680	1.5000 % ORSTED 1 1/2 02/18/3021	0	100	0	100 EUR	78.13%	78'125.00	0.01	a)
X52295333988	1.8250 % IBESM 1.825 PERP NC9	300	0	0	300 EUR	84.41%	253'239.00	0.03	a)
X52295335413	1.4500 % IBESM 1.45 PERP NC6	300	0	0	300 EUR	91.25%	273'756.00	0.04	a)
X52296203123	3.7500 % LHAGR 3 3/4 02/11/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	98.40%	196'796.00	0.03	a)
X52296204444	0.5000 % PLD 0 1/2 02/16/32	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52296206068	1.0000 % PLD 1 02/16/41	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52297177664	0.2500 % ESSITY 0 1/4 02/08/31	300	0	0	300 EUR	85.51%	256'539.00	0.04	a)
X52297190097	0.0000 % TEL 0 02/16/29	200	0	0	200 EUR	84.77%	169'538.00	0.02	a)
X52297549391	0.5000 % CABKSM 0 1/2 02/09/29 EMTN	400	0	0	400 EUR	87.64%	350'544.00	0.05	a)
X52297882644	0.1250 % VATFAL 0 1/8 02/12/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.72%	169'446.00	0.02	a)
X52298304499	0.2000 % SANTAN 0.2 02/11/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	87.34%	262'029.00	0.04	a)
X52298459426	1.2130 % BDX 1.213 02/12/36	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52299001888	0.0000 % IGIM 0 02/16/28 EMTN	100	200	0	300 EUR	87.45%	262'356.00	0.04	a)
X52299002423	0.5000 % IGIM 0 1/2 02/16/33 EMTN	250	0	0	250 EUR	74.63%	186'562.50	0.03	a)
X52299135819	1.0000 % DANBNK 1 05/15/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.00%	185'998.00	0.03	a)
X52300175655	0.5970 % JPM 0.597 02/17/33 EMTN	0	500	0	500 EUR	78.68%	393'410.00	0.05	a)
X52301127119	0.7500 % AKFAST 0 3/4 02/22/30 EMTN	200	200	200	200 EUR	77.61%	155'216.00	0.02	a)
X52303052695	0.7500 % CTPNV 0 3/4 02/18/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.06%	182'120.00	0.02	a)
X52303070911	0.2500 % HMBSS 0 1/4 08/25/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	82.27%	164'534.00	0.02	a)
X52304340263	0.2500 % EQIX 0 1/4 03/15/27	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52304340693	1.0000 % EQIX 1 03/15/33	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2304664167	0.6250 % ISPIM 0 5/8 02/24/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	93.73%	234'327.50	0.03	a)
XS2304664597	1.3500 % ISPIM 1.35 02/24/31 EMTN	250	0	0	250 EUR	83.08%	207'710.00	0.03	a)
XS2305026929	0.3420 % NTT 0.342 03/03/30 REGS	350	0	0	350 EUR	83.65%	292'768.00	0.04	a)
XS2305244241	0.2500 % LPTY 0 1/4 02/23/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	92.93%	232'330.00	0.03	a)
XS2305600723	0.0000 % SANSCF 0 02/23/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.85%	185'704.00	0.03	a)
XS2306220190	0.0000 % ALDFP 0 02/23/24 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2306220190XXX	0.0000 % ALDFP 0 02/23/24 EMTN *RETIRED*	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2306517876	0.2500 % DNBNO 0 1/4 02/23/29 EMTN	400	0	0	400 EUR	86.75%	347'012.00	0.05	a)
XS2306601746	1.8750 % EZJLN 1 7/8 03/03/28 EMTN	0	400	0	400 EUR	92.85%	371'384.00	0.05	a)
XS2306851853	0.6250 % RABOBK 0 5/8 02/25/33 GMTN	500	0	0	500 EUR	77.58%	387'885.00	0.05	a)
XS2306988564	0.5000 % ENBW 0 1/2 03/01/33 EMTN	100	0	0	100 EUR	75.94%	75'938.00	0.01	a)
XS2307768734	0.6000 % GM 0.6 05/20/27	0	232	0	232 EUR	90.86%	210'788.24	0.03	a)
XS2307853098	0.7800 % NWG 0.78 02/26/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	85.67%	257'019.00	0.04	a)
XS2307863642	0.1250 % KO 0 1/8 03/09/29	300	0	0	300 EUR	85.71%	257'136.00	0.04	a)
XS2307863998	0.5000 % KO 0 1/2 03/09/33	250	0	0	250 EUR	78.08%	195'205.00	0.03	a)
XS2307864020	1.0000 % KO 1 03/09/41	350	0	0	350 EUR	68.74%	240'576.00	0.03	a)
XS2308298962	0.3750 % DEVOBA 0 3/8 03/03/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.40%	172'794.00	0.02	a)
XS2308322002	0.5000 % BKNG 0 1/2 03/08/28	0	250	0	250 EUR	88.86%	222'145.00	0.03	a)
XS2308586911	0.1250 % SPOLNO 0 1/8 03/03/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	86.70%	173'394.00	0.02	a)
XS2308616841	0.5000 % DSVDC 0 1/2 03/03/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.24%	162'480.00	0.02	a)
XS2310118976	1.2500 % CABKSM 1 1/4 06/18/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.96%	278'892.00	0.04	a)
XS2310747915	0.1280 % ETN 0.128 03/08/26	250	0	0	250 EUR	93.42%	233'547.50	0.03	a)
XS2310748483	0.5770 % ETN 0.577 03/08/30	250	0	0	250 EUR	84.52%	211'287.50	0.03	a)
XS2310797696	1.1250 % SPG 1 1/8 03/19/33	0	300	0	300 EUR	78.63%	235'899.00	0.03	a)
XS2311407352	0.3750 % BKIR 0 3/8 05/10/27 EMTN	150	100	0	250 EUR	92.65%	231'622.50	0.03	a)
XS2311412865	0.3750 % MUBAUH 0 3/8 03/10/27 GMTN	200	0	0	200 EUR	90.27%	180'544.00	0.02	a)
XS2311413160	1.0000 % MUBAUH 1 03/10/34 GMTN	200	0	0	200 EUR	77.29%	154'576.00	0.02	a)
XS2312722916	0.2500 % MDLZ 0 1/4 03/17/28	0	200	0	200 EUR	88.00%	176'004.00	0.02	a)
XS2312723138	0.7500 % MDLZ 0 3/4 03/17/33	0	200	0	200 EUR	78.13%	156'262.00	0.02	a)
XS2312723302	1.3750 % MDLZ 1 3/8 03/17/41	0	200	0	200 EUR	69.80%	139'608.00	0.02	a)
XS2312744217	1.3750 % ENELIM 1 3/8 PERP 65Y	400	0	0	400 EUR	87.63%	350'536.00	0.05	a)
XS2312746345	1.8750 % ENELIM 1 7/8 PERP 95Y	300	0	0	300 EUR	81.45%	244'356.00	0.03	a)
XS2314246526	1.5000 % STEDIN 1 1/2 PERP	100	0	0	100 EUR	90.47%	90'467.00	0.01	a)
XS2314312179	1.3750 % AXASA 1 3/8 10/07/41 EMTN	200	100	0	300 EUR	81.26%	243'777.00	0.03	a)
XS2314657409	0.7500 % PRIFII 0 3/4 03/23/33 EMTN	300	0	0	300 EUR	74.30%	222'906.00	0.03	a)
XS2315784806	1.2500 % APAAU 1 1/4 03/15/33 EMTN	250	0	0	250 EUR	78.71%	196'767.50	0.03	a)
XS2317069685	0.7500 % ISPIM 0 3/4 03/16/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.16%	267'474.00	0.04	a)
XS2317288301	0.3750 % ADNA 0 3/8 03/18/30	250	0	0	250 EUR	83.27%	208'175.00	0.03	a)
XS2319954710	1.2000 % STANLN 1.2 09/23/31 EMTN	250	0	0	250 EUR	90.57%	226'425.00	0.03	a)
XS2320438653	0.6250 % CDTFIN 0 5/8 03/19/30 EMTN	150	0	0	150 EUR	82.95%	124'431.00	0.02	a)
XS2320453884	0.5000 % UPMFH 0 1/2 03/22/31 EMTN	150	0	0	150 EUR	81.12%	121'675.50	0.02	a)
XS2320533131	2.5000 % REPSM 2 1/2 PERP	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2320745156	1.3750 % HANRUE 1 3/8 06/30/42	400	0	0	400 EUR	79.32%	317'260.00	0.04	a)
XS2320746394	0.9000 % VERAU 0.9 04/01/41	200	0	0	200 EUR	65.87%	131'736.00	0.02	a)
XS2320747285	0.2500 % OPBANK 0 1/4 03/24/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2320759538	0.3750 % VZ 0 3/8 03/22/29	0	300	0	300 EUR	85.60%	256'800.00	0.04	a)
XS2320759884	0.7500 % VZ 0 3/4 03/22/32	0	400	0	400 EUR	79.81%	319'232.00	0.04	a)
XS2320760114	1.1250 % VZ 1 1/8 09/19/35	0	250	0	250 EUR	75.07%	187'680.00	0.03	a)
XS2320789014	0.1250 % HYNOC 0 1/8 06/30/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.60%	181'194.00	0.02	a)
XS2321427408	0.6940 % BAC 0.694 03/22/31 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2321466133	1.1250 % BACR 1 1/8 03/22/31 EMTN	250	0	0	250 EUR	92.17%	230'422.50	0.03	a)
XS2321526480	0.5000 % NDAFH 0 1/2 03/19/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	81.82%	81'821.00	0.01	a)
XS2322254249	1.0000 % GS 1 03/18/33 EMTN	400	0	0	400 EUR	78.45%	313'792.00	0.04	a)
XS2322289385	0.1250 % BBVASM 0 1/8 03/24/27 GMTN	300	0	0	300 EUR	92.85%	278'544.00	0.04	a)
XS2322423539	3.7500 % IAGLN 3 3/4 03/25/29	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2322438990	0.8750 % CZGRID 0 7/8 03/31/31	150	0	0	150 EUR	80.66%	120'987.00	0.02	a)
XS2323295563	0.0460 % NIDEC 0.046 03/30/26	0	200	0	200 EUR	92.58%	185'158.00	0.03	a)
XS2324321285	0.5000 % SANTAN 0 1/2 03/24/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	93.15%	279'447.00	0.04	a)
XS2325562424	0.0000 % FREGR 0 10/01/25	200	0	0	200 EUR	94.39%	188'782.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2325562697	0.8750 % FREGR 0 7/8 10/01/31 EMTN	150	0	0	150 EUR	79.59%	119'386.50	0.02	a)
XS2325565104	0.5000 % FREGR 0 1/2 10/01/28 EMTN	150	0	0	150 EUR	87.46%	131'182.50	0.02	a)
XS2326546350	0.5000 % UBS 0 1/2 03/31/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	80.40%	241'212.00	0.03	a)
XS2326546434	0.0100 % UBS 0.01 03/31/26 EMTN	500	0	0	500 EUR	92.81%	464'060.00	0.06	a)
XS2327299298	0.2500 % LSELN 0 1/4 04/06/28 GMTN	0	200	0	200 EUR	88.26%	176'516.00	0.02	a)
XS2327299884	0.7500 % LSELN 0 3/4 04/06/33	200	0	0	200 EUR	78.52%	157'044.00	0.02	a)
XS2327420977	0.6000 % EOANGR 0.6 10/01/32 EMTN	400	0	0	400 EUR	79.31%	317'244.00	0.04	a)
XS2328823104	1.1250 % HTHROW 1 1/8 10/08/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.50%	169'004.00	0.02	a)
XS2328980979	0.0100 % ASABRE 0.01 04/19/24	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2328981431	0.3360 % ASABRE 0.336 04/19/27	150	0	0	150 EUR	90.23%	135'339.00	0.02	a)
XS2329144591	0.8430 % MIZUHO 0.843 04/12/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	79.14%	158'282.00	0.02	a)
XS2331216577	0.1250 % SCBNOR 0 1/8 04/14/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.27%	184'546.00	0.03	a)
XS2331315635	0.3750 % ENEXIS 0 3/8 04/14/33 EMTN	350	0	0	350 EUR	76.94%	269'304.00	0.04	a)
XS2332179725	0.0500 % LFBANK 0.05 04/15/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2332234413	0.1250 % SGSNVX 0 1/8 04/21/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	89.88%	269'634.00	0.04	a)
XS2332254015	0.0000 % CAABNK 0 04/16/24 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2332525241	1.6250 % LOUDRE 1 5/8 04/28/28	200	0	0	200 EUR	91.55%	183'100.00	0.03	a)
XS2332689681	0.3750 % DNFSDC 0 3/8 10/28/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	86.03%	215'067.50	0.03	a)
XS2332689764	0.7500 % DNFSDC 0 3/4 04/28/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.37%	162'748.00	0.02	a)
XS2332980932	0.7500 % AMCOSP 0 3/4 04/20/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.02%	174'032.00	0.02	a)
XS2333391485	0.7500 % LUCSHI 0 3/4 04/22/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.30%	156'590.00	0.02	a)
XS2334852253	2.0000 % ENIIM 2 PERP NC6	0	300	0	300 EUR	91.38%	274'125.00	0.04	a)
XS2334857138	2.7500 % ENIIM 2 3/4 PERP NC9	0	200	0	200 EUR	86.75%	173'500.00	0.02	a)
XS2337060607	0.0000 % CCEP 0 09/06/25	150	0	0	150 EUR	94.45%	141'676.50	0.02	a)
XS2337061670	0.5000 % CCEP 0 1/2 09/06/29	100	0	0	100 EUR	84.99%	84'987.00	0.01	a)
XS2337061753	0.8750 % CCEP 0 7/8 05/06/33	300	0	0	300 EUR	78.82%	236'463.00	0.03	a)
XS2337061837	1.5000 % CCEP 1 1/2 05/06/41	250	0	0	250 EUR	71.97%	179'922.50	0.02	a)
XS2337252931	0.4500 % FDX 0.45 05/04/29	200	0	0	200 EUR	85.48%	170'954.00	0.02	a)
XS2337253319	0.9500 % FDX 0.95 05/04/33	150	0	0	150 EUR	76.88%	115'314.00	0.02	a)
XS2337285519	0.5000 % FEMSA 0 1/2 05/28/28	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2337285865	1.0000 % FEMSA 1 05/28/33	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2337326727	1.7500 % ADRIT 1 3/4 07/30/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.38%	170'756.00	0.02	a)
XS2338643740	0.4060 % MS 0.406 10/29/27	600	0	0	600 EUR	91.58%	549'498.00	0.08	a)
XS2338955805	0.1250 % TOYOTA 0 1/8 11/05/27 EMTN	0	350	0	350 EUR	88.44%	309'547.00	0.04	a)
XS2339398971	0.4000 % KO 0.4 05/06/30	300	0	0	300 EUR	84.10%	252'288.00	0.03	a)
XS2339399359	0.9500 % KO 0.95 05/06/36	100	0	0	100 EUR	75.40%	75'400.00	0.01	a)
XS2340236327	1.3750 % BKIR 1 3/8 08/11/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.75%	185'502.00	0.03	a)
XS2341269970	1.1250 % AKERBP 1 1/8 05/12/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2342058117	0.6250 % HITTFP 0 5/8 09/14/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	87.26%	87'257.00	0.01	a)
XS2342060360	1.1060 % BACR 1.106 05/12/32	400	0	0	400 EUR	80.82%	323'280.00	0.04	a)
XS2342206591	0.7660 % WSTP 0.766 05/13/31	300	0	0	300 EUR	91.77%	275'316.00	0.04	a)
XS2342227837	1.0000 % SAGAX 1 05/17/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	85.39%	85'389.00	0.01	a)
XS2342706996	0.0000 % VLVY 0 05/18/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	92.31%	138'466.50	0.02	a)
XS2342732562	3.7480 % VW 3.748 PERP	300	100	300	100 EUR	93.06%	93'063.00	0.01	a)
XS2342732646	4.3750 % VW 4 3/8 PERP	400	300	400	300 EUR	90.18%	270'534.00	0.04	a)
XS2343114687	0.8750 % ERFPP 0 7/8 05/19/31	150	0	0	150 EUR	78.76%	118'137.00	0.02	a)
XS2343340852	0.5000 % AIB 0 1/2 11/17/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.38%	182'756.00	0.03	a)
XS2343459074	0.6250 % NDAFH 0 5/8 08/18/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	91.42%	274'257.00	0.04	a)
XS2343540519	0.5000 % REESM 0 1/2 05/24/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.80%	157'594.00	0.02	a)
XS2343563214	0.3000 % SWEDA 0.3 05/20/27	350	0	0	350 EUR	92.15%	322'528.50	0.04	a)
XS2343821794	0.0000 % VW 0 07/19/24 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2343822503	0.6250 % VW 0 5/8 07/19/29 EMTN	150	150	150	150 EUR	84.66%	126'991.50	0.02	a)
XS2343822842	0.3750 % VW 0 3/8 07/20/26 EMTN	300	300	300	300 EUR	92.23%	276'687.00	0.04	a)
XS2343846940	1.0000 % BWA 1 05/19/31	0	350	0	350 EUR	80.80%	282'782.50	0.04	a)
XS2343850033	0.9500 % MQGAU 0.95 05/21/31 EMTN	250	0	0	250 EUR	83.08%	207'687.50	0.03	a)
XS2344384768	0.1000 % ONTTFT 0.1 05/19/28 EMTN	300	100	0	400 EUR	87.78%	351'108.00	0.05	a)
XS2344384842	0.9000 % ONTTFT 0.9 05/20/41 EMTN	350	0	0	350 EUR	67.07%	234'748.50	0.03	a)
XS2344385815	0.8750 % RYAUD 0 7/8 05/25/26 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2344569038	0.8750 % SEGPLP 0 7/8 05/27/29	150	0	0	150 EUR	85.05%	127'576.50	0.02	a)
XS2344735811	0.3750 % ENIIM 0 3/8 06/14/28 EMTN	0	500	0	500 EUR	87.29%	436'455.00	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2344772426	1.7500 % HMSOLN 1 3/4 06/03/27	250	0	0	250 EUR	89.92%	224'810.00	0.03	a)
XS2345035963	1.2500 % WAB 1 1/4 12/03/27	0	200	0	200 EUR	90.81%	181'610.00	0.02	a)
XS2345317510	0.0500 % SHBASS 0.05 09/06/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	86.18%	258'534.00	0.04	a)
XS2345798271	1.1020 % BAC 1.102 05/24/32 EMTN	500	0	500	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2345799089	0.5830 % BAC 0.583 08/24/28 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2345982362	0.2500 % UBS 0 1/4 01/05/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	93.64%	374'560.00	0.05	a)
XS2345996743	1.0000 % ERICB 1 05/26/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	83.66%	167'316.00	0.02	a)
XS2346124410	0.3750 % HESLAN 0 3/8 06/04/29 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2346206902	0.4500 % AMT 0.45 01/15/27	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2346207892	0.8750 % AMT 0 7/8 05/21/29	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2346208197	1.2500 % AMT 1 1/4 05/21/33	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2346225878	0.5000 % MET 0 1/2 05/25/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	85.92%	257'748.00	0.04	a)
XS2346253730	0.7500 % CABKSM 0 3/4 05/26/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	90.73%	272'199.00	0.04	a)
XS2347367018	1.3750 % MRLSM 1 3/8 06/01/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	84.96%	169'912.00	0.02	a)
XS2347663507	0.3750 % AZN 0 3/8 06/03/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.05%	172'094.00	0.02	a)
XS2348030268	0.0000 % NOVOB 0 06/04/24 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2348030425	0.1250 % NOVOB 0 1/8 06/04/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	88.09%	220'230.00	0.03	a)
XS2348325221	0.1250 % TENN 0 1/8 12/09/27 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2348325494	0.5000 % TENN 0 1/2 06/09/31 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2348325650	1.1250 % TENN 1 1/8 06/09/41 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2348408514	1.0000 % SPPDIS 1 06/09/31	150	0	0	150 EUR	75.19%	112'777.50	0.02	a)
XS2348638433	1.0000 % ABNAV 1 06/02/33	300	0	0	300 EUR	81.44%	244'308.00	0.03	a)
XS2348703864	1.0000 % BEVLUX 1 01/16/30	200	0	0	200 EUR	83.18%	166'354.00	0.02	a)
XS2349788377	0.3370 % MUFU 0.337 06/08/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.28%	184'568.00	0.03	a)
XS2350621863	0.0000 % NESNVX 0 06/14/26 EMTN	500	0	0	500 EUR	92.82%	464'080.00	0.06	a)
XS2350632472	0.2500 % NESNVX 0 1/4 06/14/29 EMTN	150	0	0	150 EUR	86.33%	129'495.00	0.02	a)
XS2350744434	0.8750 % NESNVX 0 7/8 06/14/41 EMTN	200	0	0	200 EUR	68.44%	136'884.00	0.02	a)
XS2350746215	0.6250 % NESNVX 0 5/8 02/14/34 EMTN	150	0	0	150 EUR	78.06%	117'091.50	0.02	a)
XS2350756446	0.8750 % INTNED 0 7/8 06/09/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	89.01%	89'007.00	0.01	a)
XS2351032227	0.8750 % WORAU 0 7/8 06/09/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.84%	185'672.00	0.03	a)
XS2351220814	0.7500 % DANBNK 0 3/4 06/09/29 EMTN	150	0	0	150 EUR	87.38%	131'067.00	0.02	a)
XS2351301499	0.7500 % AXACOR 0 3/4 06/14/28	200	0	0	200 EUR	85.40%	170'792.00	0.02	a)
XS2353182020	0.0000 % ENELIM 0 06/17/27 EMTN	400	0	0	400 EUR	89.04%	356'156.00	0.05	a)
XS2353182293	0.5000 % ENELIM 0 1/2 06/17/30 EMTN	400	0	0	400 EUR	82.75%	331'008.00	0.05	a)
XS2353182376	0.8750 % ENELIM 0 7/8 06/17/36 EMTN	400	0	0	400 EUR	70.26%	281'056.00	0.04	a)
XS2353473692	1.3750 % RBLAV 1 3/8 06/17/33	200	0	0	200 EUR	83.69%	167'384.00	0.02	a)
XS2354246816	0.3750 % OPBANK 0 3/8 06/16/28 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2354444023	0.0000 % JDEPNA 0 01/16/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.00%	185'998.00	0.03	a)
XS2354444379	1.1250 % JDEPNA 1 1/8 06/16/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	76.82%	153'630.00	0.02	a)
XS2354569407	0.5000 % JDEPNA 0 1/2 01/16/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.16%	170'328.00	0.02	a)
XS2355599197	0.1250 % NWG 0 1/8 06/18/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.44%	277'305.00	0.04	a)
XS2355632741	1.3750 % TVOYFH 1 3/8 06/23/28 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2356029541	0.5000 % CTPNV 0 1/2 06/21/25 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2356030556	1.2500 % CTPNV 1 1/4 06/21/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.40%	170'790.00	0.02	a)
XS2356040357	0.7500 % STLA 0 3/4 01/18/29 EMTN	500	0	0	500 EUR	87.37%	436'855.00	0.06	a)
XS2356041165	1.2500 % STLA 1 1/4 06/20/33 EMTN	350	0	0	350 EUR	79.64%	278'740.00	0.04	a)
XS2356049069	0.3750 % SEB 0 3/8 06/21/28 GMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2356091269	0.2500 % DEVOBA 0 1/4 06/22/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.94%	183'888.00	0.03	a)
XS2356311139	0.8800 % AIA 0.88 09/09/33 GMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2356569736	1.0000 % BYLAN 1 09/23/31 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2357205587	0.3750 % TRNIM 0 3/8 06/23/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.26%	170'514.00	0.02	a)
XS2357417257	0.6250 % SANTAN 0 5/8 06/24/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	87.54%	262'611.00	0.04	a)
XS2357754097	1.7130 % ASSGEN 1.713 06/30/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	80.59%	80'585.00	0.01	a)
XS2358231798	0.6250 % SRGIM 0 5/8 06/30/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.72%	161'448.00	0.02	a)
XS2358287238	0.0100 % UBS 0.01 06/29/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	92.23%	184'450.00	0.03	a)
XS2358471246	0.5000 % YBS 0 1/2 07/01/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	87.15%	217'865.00	0.03	a)
XS2358736051	0.4190 % CHGRID 0.419 09/08/28	300	0	0	300 EUR	86.01%	258'042.00	0.04	a)
XS2360310044	0.8000 % UCGIM 0.8 07/05/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.28%	264'837.00	0.04	a)
XS2360853332	1.2880 % PRXNA 1.288 07/13/29 REGS	0	350	0	350 EUR	82.47%	288'634.50	0.04	a)
XS2360881549	0.7500 % DSVDC 0 3/4 07/05/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	77.19%	154'376.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
X52361358299	0.3750 % REPSM 0 3/8 07/06/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52361358539	0.8750 % REPSM 0 7/8 07/06/33 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52362968906	0.1000 % WSTPNZ 0.1 07/13/27	250	0	0	250 EUR	88.83%	222'065.00	0.03 a)	
X52363117321	0.3000 % HNDA 0.3 07/07/28	400	0	0	400 EUR	87.31%	349'256.00	0.05 a)	
X52363203089	1.9850 % PRXNA 1.985 07/13/33 REGS	0	350	0	350 EUR	75.13%	262'965.50	0.04 a)	
X52363235107	3.5000 % LHAGR 3 1/2 07/14/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	96.47%	192'946.00	0.03 a)	
X52364001078	0.6250 % AEMSPA 0 5/8 07/15/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.97%	157'948.00	0.02 a)	
X52366407018	0.8000 % TMO 0.8 10/18/30	0	500	0	500 EUR	84.38%	421'875.00	0.06 a)	
X52366415110	1.1250 % TMO 1 1/8 10/18/33	0	500	0	500 EUR	80.75%	403'740.00	0.06 a)	
X52366415201	1.6250 % TMO 1 5/8 10/18/41	0	400	0	400 EUR	72.63%	290'520.00	0.04 a)	
X52369906644	0.9000 % NDAQ 0.9 07/30/33	350	0	0	350 EUR	76.91%	269'174.50	0.04 a)	
X52373642102	0.5770 % BACR 0.577 08/09/29	500	0	0	500 EUR	86.09%	430'435.00	0.06 a)	
X52374594823	0.3750 % VW 0 3/8 02/12/30 EMTN	250	250	250	250 EUR	82.40%	205'997.50	0.03 a)	
X52374595044	0.1250 % VW 0 1/8 02/12/27 EMTN	350	250	350	250 EUR	90.30%	225'760.00	0.03 a)	
X52374595127	0.0000 % VW 0 02/12/25 EMTN	150	100	150	100 EUR	96.54%	96'541.00	0.01 a)	
X52375844144	0.3340 % BDX 0.334 08/13/28	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52375844656	1.3360 % BDX 1.336 08/13/41	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52381261424	1.0000 % MUNRE 1 05/26/42	300	0	0	300 EUR	77.47%	232'410.00	0.03 a)	
X52381277008	2.1250 % ENBW 2 1/8 08/31/2081	200	0	0	200 EUR	78.63%	157'256.00	0.02 a)	
X52381362966	0.2500 % BNS 0 1/4 11/01/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	86.24%	215'597.50	0.03 a)	
X52381560411	0.2500 % ASBBNK 0 1/4 09/08/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	85.68%	257'046.00	0.04 a)	
X52381599898	0.0500 % RBAV 0.05 09/01/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.02%	174'048.00	0.02 a)	
X52381671671	0.2500 % UBS 0 1/4 09/01/28 EMTN	1'000	0	200	800 EUR	85.72%	685'792.00	0.09 a)	
X52381853279	0.2500 % NGGLN 0 1/4 09/01/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	86.05%	344'216.00	0.05 a)	
X52381853436	0.7500 % NGGLN 0 3/4 09/01/33 EMTN	400	0	0	400 EUR	75.26%	301'044.00	0.04 a)	
X52382849888	0.0500 % JYBC 0.05 09/02/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	93.91%	187'824.00	0.03 a)	
X52382950330	1.0430 % NWG 1.043 09/14/32 EMTN	150	0	0	150 EUR	88.18%	132'276.00	0.02 a)	
X52383886947	0.0000 % LXSGR 0 09/08/27 EMTN	150	0	0	150 EUR	87.08%	130'618.50	0.02 a)	
X52383901761	0.4700 % MIZUHO 0.47 09/06/29	0	300	0	300 EUR	85.59%	256'758.00	0.04 a)	
X52384269101	0.2500 % LPTY 0 1/4 09/07/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	91.43%	274'278.00	0.04 a)	
X52384269366	0.7500 % HEIBOS 0 3/4 09/06/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	72.09%	180'230.00	0.02 a)	
X52384274366	0.6500 % GM 0.65 09/07/28	400	0	0	400 EUR	86.77%	347'060.00	0.05 a)	
X52384274440	0.3750 % WOWAU 0 3/8 11/15/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.84%	171'672.00	0.02 a)	
X52384413311	0.3660 % ATH 0.366 09/10/26 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52384473992	0.3750 % OPBANK 0 3/8 12/08/28 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52384697830	0.5000 % PSA 0 1/2 09/09/30	250	0	0	250 EUR	81.29%	203'230.00	0.03 a)	
X52384715244	0.4500 % DXC 0.45 09/15/27 REGS	250	0	0	250 EUR	88.09%	220'227.50	0.03 a)	
X52384716721	0.9500 % DXC 0.95 09/15/31 REGS	200	0	0	200 EUR	76.78%	153'552.00	0.02 a)	
X52384723263	0.2500 % MDLZ 0 1/4 09/09/29 REGS	0	200	0	200 EUR	84.19%	168'376.00	0.02 a)	
X52384726282	0.6250 % MDLZ 0 5/8 09/09/32 REGS	0	200	0	200 EUR	78.50%	156'996.00	0.02 a)	
X52384726449	1.2500 % MDLZ 1 1/4 09/09/41 REGS	0	250	0	250 EUR	68.37%	170'922.50	0.02 a)	
X52384734542	0.2500 % NIBCAP 0 1/4 09/09/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	91.07%	273'216.00	0.04 a)	
X52385114298	0.6250 % CE 0 5/8 09/10/28	0	150	0	150 EUR	85.01%	127'515.00	0.02 a)	
X52385390724	0.6250 % SAUR 0 5/8 09/16/28	200	0	0	200 EUR	86.62%	173'230.00	0.02 a)	
X52385397901	0.0000 % CMCSA 0 09/14/26	357	0	357	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52385398206	0.2500 % CMCSA 0 1/4 09/14/29	201	0	201	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52385790667	0.2500 % NWIDE 0 1/4 09/14/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.37%	172'748.00	0.02 a)	
X52385791046	0.6030 % SANUK 0.603 09/13/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	85.35%	256'044.00	0.04 a)	
X52386186063	0.5000 % LLY 0 1/2 09/14/33	300	0	0	300 EUR	78.77%	236'310.00	0.03 a)	
X52386186576	1.1250 % LLY 1 1/8 09/14/51	250	0	0	250 EUR	61.52%	153'795.00	0.02 a)	
X52386220698	1.3750 % LLY 1 3/8 09/14/61	200	0	0	200 EUR	56.50%	113'004.00	0.02 a)	
X52386592484	0.1250 % ADENVX 0 1/8 09/21/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	86.78%	86'781.00	0.01 a)	
X52386592567	0.5000 % ADENVX 0 1/2 09/21/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	79.97%	159'936.00	0.02 a)	
X52387052744	0.8750 % CASTSS 0 7/8 09/17/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	78.73%	196'820.00	0.03 a)	
X52387060259	0.6700 % NWG 0.67 09/14/29	300	0	0	300 EUR	86.37%	259'104.00	0.04 a)	
X52387735470	0.8750 % DSVDC 0 7/8 09/17/36 EMTN	150	0	0	150 EUR	71.85%	107'775.00	0.01 a)	
X52388182573	0.5000 % SKGID 0 1/2 09/22/29	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52388183381	1.0000 % SKGID 1 09/22/33	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52388449758	0.5000 % NNGRNV 0 1/2 09/21/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	86.97%	86'972.00	0.01 a)	
X52388491289	0.6410 % HSBC 0.641 09/24/29	200	0	0	200 EUR	86.77%	173'530.00	0.02 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2388557998	1.4670 % BPLN 1.467 09/21/41	300	0	0	300 EUR	68.45%	205'350.00	0.03	a)
XS2389343380	0.5000 % ABNAV 0 1/2 09/23/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	84.22%	252'669.00	0.03	a)
XS2389353264	0.7500 % GS 0 3/4 03/23/32 EMTN	400	0	0	400 EUR	78.51%	314'048.00	0.04	a)
XS2389688107	0.3750 % VITRRA 0 3/8 09/24/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	94.09%	188'174.00	0.03	a)
XS2389688875	1.0000 % VITRRA 1 09/24/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	88.04%	220'095.00	0.03	a)
XS2389757944	0.2000 % ANZNZ 0.2 09/23/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	88.88%	266'652.00	0.04	a)
XS2390400633	0.0000 % ENELIM 0 05/28/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.14%	184'270.00	0.03	a)
XS2390400716	0.3750 % ENELIM 0 3/8 05/28/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	85.04%	212'600.00	0.03	a)
XS2390400807	0.8750 % ENELIM 0 7/8 09/28/34 EMTN	500	0	0	500 EUR	73.89%	369'430.00	0.05	a)
XS2390506546	0.3750 % INTNED 0 3/8 09/29/28	500	0	0	500 EUR	88.26%	441'310.00	0.06	a)
XS2390530330	0.6250 % CTPNV 0 5/8 09/27/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	91.51%	137'257.50	0.02	a)
XS2390546849	1.5000 % CTPNV 1 1/2 09/27/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.20%	160'406.00	0.02	a)
XS2391430837	0.8750 % AUSGF 0 7/8 10/07/31 EMTN	150	0	0	150 EUR	80.20%	120'292.50	0.02	a)
XS2391861064	0.3750 % LIN 0 3/8 09/30/33	0	100	0	100 EUR	75.56%	75'556.00	0.01	a)
XS2391865305	1.0000 % LIN 1 09/30/51 EMTN	0	300	0	300 EUR	58.70%	176'097.00	0.02	a)
XS2393080077	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/04/28 GMTN	200	0	0	200 EUR	86.99%	173'986.00	0.02	a)
XS2393236000	0.2500 % MCD 0 1/4 10/04/28 GMTN	0	150	0	150 EUR	86.38%	129'568.50	0.02	a)
XS2393236695	0.8750 % MCD 0 7/8 10/04/33 GMTN	0	250	0	250 EUR	78.21%	195'517.50	0.03	a)
XS2393323071	0.8000 % AGCO 0.8 10/06/28	0	200	0	200 EUR	86.17%	172'336.00	0.02	a)
XS2393701953	0.9500 % AMT 0.95 10/05/30	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2394063437	0.5000 % BNRGR 0 1/2 10/06/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2397239000	0.2500 % HEIBOS 0 1/4 10/13/24 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.24%	192'486.00	0.03	a)
XS2397252011	1.6250 % HEIBOS 1 5/8 10/13/31 EMTN	250	0	0	250 EUR	69.81%	174'525.00	0.02	a)
XS2397252102	1.0000 % HEIBOS 1 04/13/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	78.71%	78'711.00	0.01	a)
XS2397357463	0.9000 % CBREGI 0.9 10/12/29	200	0	0	200 EUR	82.15%	164'298.00	0.02	a)
XS2397367421	0.7500 % PEP 0 3/4 10/14/33	300	300	0	600 EUR	78.87%	473'190.00	0.06	a)
XS2398710546	0.7500 % VESTNL 0 3/4 10/18/31 EMTN	150	0	0	150 EUR	79.52%	119'272.50	0.02	a)
XS2398807383	0.5000 % FINBAN 0 1/2 10/21/27	200	0	0	200 EUR	91.30%	182'600.00	0.03	a)
XS2399154181	0.9540 % WESAU 0.954 10/21/33 EMTN	250	0	0	250 EUR	77.22%	193'050.00	0.03	a)
XS2399933386	1.0000 % HERIM 1 04/25/34 EMTN	150	0	0	150 EUR	75.42%	113'131.50	0.02	a)
XS2400296773	0.7500 % FNMIM 0 3/4 10/20/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	91.22%	228'045.00	0.03	a)
XS2400445289	0.5000 % DELL 0 1/2 10/27/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	91.92%	137'872.50	0.02	a)
XS2401704189	1.2500 % AXACOR 1 1/4 04/26/30	200	0	0	200 EUR	81.02%	162'044.00	0.02	a)
XS2402178300	0.7500 % CKHH 0 3/4 11/02/29	0	200	0	200 EUR	83.88%	167'766.00	0.02	a)
XS2402178565	1.0000 % CKHH 1 11/02/33	0	150	0	150 EUR	75.58%	113'376.00	0.02	a)
XS2403444677	0.5000 % NDAFH 0 1/2 11/02/28 EMTN	350	0	0	350 EUR	86.66%	303'303.00	0.04	a)
XS2403519601	1.7500 % BCRED 1 3/4 11/30/26 REGS	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2403533263	1.0000 % AEMSPA 1 11/02/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	75.45%	150'908.00	0.02	a)
XS2404027935	0.2500 % SWEDA 0 1/4 11/02/26 GMTN	350	0	0	350 EUR	91.82%	321'384.00	0.04	a)
XS2404028230	1.1020 % MS 1.102 04/29/33 GMTN	400	0	0	400 EUR	80.40%	321'584.00	0.04	a)
XS2404213485	0.3500 % PG 0.35 05/05/30	100	0	0	100 EUR	84.50%	84'500.00	0.01	a)
XS2404214020	0.9000 % PG 0.9 11/04/41	160	0	0	160 EUR	67.66%	108'260.80	0.01	a)
XS2404247384	0.7500 % SEB 0 3/4 11/03/31 GMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2404629235	0.1250 % SHBASS 0 1/8 11/03/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	91.43%	274'281.00	0.04	a)
XS2404642923	0.8750 % GS 0 7/8 05/09/29 EMTN	274	0	0	274 EUR	86.21%	236'215.40	0.03	a)
XS2404651163	1.0000 % SANTAN 1 11/04/31 EMTN	400	0	0	400 EUR	83.60%	334'400.00	0.05	a)
XS2405390043	0.5000 % SYDBDC 0 1/2 11/10/26 GMTN	200	0	0	200 EUR	93.83%	187'666.00	0.03	a)
XS2405467528	0.1250 % GIS 0 1/8 11/15/25	200	0	0	200 EUR	94.08%	188'152.00	0.03	a)
XS2405855375	1.5750 % IBESM 1.575 PERP	200	0	0	200 EUR	89.09%	178'180.00	0.02	a)
XS2405875480	0.3000 % CL 0.3 11/10/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.62%	171'232.00	0.02	a)
XS2406569579	0.8750 % TENN 0 7/8 06/16/35 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2406890066	0.8750 % KPN 0 7/8 11/15/33 GMTN	400	0	0	400 EUR	77.67%	310'688.00	0.04	a)
XS2406914346	0.3180 % OTIS 0.318 12/15/26	300	0	0	300 EUR	91.28%	273'846.00	0.04	a)
XS2406915236	0.9340 % OTIS 0.934 12/15/31	200	0	0	200 EUR	81.53%	163'056.00	0.02	a)
XS2407010656	0.6250 % JDEPNA 0 5/8 02/09/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	88.43%	221'072.50	0.03	a)
XS2407357768	0.1250 % NWG 0 1/8 11/12/25 EMTN	350	0	0	350 EUR	94.03%	329'101.50	0.05	a)
XS2407529309	1.0000 % INTNED 1 11/16/32	300	0	0	300 EUR	88.34%	265'023.00	0.04	a)
XS2407914394	0.0000 % TMO 0 11/18/25	0	200	0	200 EUR	94.26%	188'528.00	0.03	a)
XS2407955827	0.5000 % HENKEL 0 1/2 11/17/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.35%	160'708.00	0.02	a)
XS2407969885	0.8000 % STANLN 0.8 11/17/29	200	0	0	200 EUR	86.42%	172'844.00	0.02	a)
XS2407985220	0.0000 % STEDIN 0 11/16/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	90.59%	135'891.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
X52408458730	2.8750 % LHAGR 2 7/8 05/16/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	95.99%	287'955.00	0.04	a)
X52409134371	0.2500 % JYBC 0 1/4 02/17/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	89.72%	179'432.00	0.02	a)
X52410368042	0.7500 % MAERSK 0 3/4 11/25/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.23%	160'462.00	0.02	a)
X52411135150	0.9500 % ONTTFT 0.95 11/24/51 EMTN	200	0	0	200 EUR	54.69%	109'372.00	0.02	a)
X52411166973	0.8750 % NNGRNV 0 7/8 11/23/31 EMTN	250	0	0	250 EUR	83.92%	209'795.00	0.03	a)
X52411178630	1.3750 % BYLAN 1 3/8 11/22/32 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52411241693	1.7500 % TALANX 1 3/4 12/01/42	0	300	100	200 EUR	81.31%	162'624.00	0.02	a)
X52411311579	0.0820 % NTT 0.082 12/13/25 EMTN	250	0	0	250 EUR	93.99%	234'965.00	0.03	a)
X52411311652	0.3990 % NTT 0.399 12/13/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	86.96%	217'405.00	0.03	a)
X52411720233	0.3750 % SANDSS 0 3/8 11/25/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.61%	173'212.00	0.02	a)
X52412267358	1.0000 % ATIM 1 11/25/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	92.58%	231'437.50	0.03	a)
X52412267515	1.5000 % ATIM 1 1/2 01/25/30 EMTN	400	0	0	400 EUR	85.23%	340'912.00	0.05	a)
X52412267788	2.3750 % ATIM 2 3/8 11/25/33 EMTN	300	0	0	300 EUR	82.68%	248'049.00	0.03	a)
X52413696761	0.1250 % INTNED 0 1/8 11/29/25	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52413697140	0.8750 % INTNED 0 7/8 11/29/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.34%	168'682.00	0.02	a)
X52414830963	0.8750 % KYGID 0 7/8 12/01/31	200	0	0	200 EUR	82.26%	164'518.00	0.02	a)
X52415386726	0.6250 % LXSGR 0 5/8 12/01/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.32%	160'634.00	0.02	a)
X52416413339	0.3750 % RABOBK 0 3/8 12/01/27 GMTN	300	0	0	300 EUR	91.43%	274'299.00	0.04	a)
X52421006201	0.4270 % WSTPNZ 0.427 12/14/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.41%	182'812.00	0.03	a)
X52428716000	1.3750 % DLR 1 3/8 07/18/32	150	0	0	150 EUR	80.02%	120'025.50	0.02	a)
X52430284930	0.4400 % TOYOTA 0.44 01/13/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	88.80%	177'604.00	0.02	a)
X52430287362	2.0850 % PRXNA 2.085 01/19/30 REGS	0	250	0	250 EUR	84.59%	211'467.50	0.03	a)
X52430287875	2.7780 % PRXNA 2.778 01/19/34 REGS	0	250	0	250 EUR	78.96%	197'397.50	0.03	a)
X52430951660	0.8770 % BACR 0.877 01/28/28	200	0	0	200 EUR	91.90%	183'802.00	0.03	a)
X52430970884	0.8320 % ATH 0.832 01/08/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52430998893	0.8750 % BBVASM 0 7/8 01/14/29	300	0	0	300 EUR	89.79%	269'364.00	0.04	a)
X52431029441	1.8750 % AXASA 1 7/8 07/10/42 EMTN	400	0	0	400 EUR	81.43%	325'724.00	0.04	a)
X52431319107	2.0000 % LOGICR 2 01/17/34 EMTN	200	0	0	200 EUR	76.53%	153'066.00	0.02	a)
X52431320378	1.0000 % BACRED 1 07/17/29 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52432130610	2.0000 % TTEFP 2 PERP	200	0	0	200 EUR	92.38%	184'750.00	0.03	a)
X52432131188	3.2500 % TTEFP 3 1/4 PERP	200	0	0	200 EUR	83.50%	167'000.00	0.02	a)
X52432162654	1.7500 % CPIPGR 1 3/4 01/14/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	69.25%	173'125.00	0.02	a)
X52432293673	0.2500 % ENELIM 0 1/4 11/17/25	200	0	0	200 EUR	94.20%	188'404.00	0.03	a)
X52432293756	0.8750 % ENELIM 0 7/8 01/17/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	83.18%	166'366.00	0.02	a)
X52432293913	1.2500 % ENELIM 1 1/4 01/17/35 EMTN	250	0	0	250 EUR	76.88%	192'205.00	0.03	a)
X52432361421	0.8750 % NIBCAP 0 7/8 06/24/27 EM7N	0	200	0	200 EUR	90.89%	181'772.00	0.02	a)
X52432502008	0.5000 % TD 0 1/2 01/18/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	91.99%	275'982.00	0.04	a)
X52432530637	0.5000 % SANSCF 0 1/2 01/14/27 EMTN	200	100	0	300 EUR	91.25%	273'738.00	0.04	a)
X52432544349	1.0000 % ESBIRE 1 07/19/34 EMTN	200	0	0	200 EUR	78.19%	156'376.00	0.02	a)
X52432565005	1.0000 % BALDER 1 01/18/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	87.54%	87'537.00	0.01	a)
X52432567555	0.3750 % DNBNO 0 3/8 01/18/28 EMTN	200	100	0	300 EUR	91.13%	273'402.00	0.04	a)
X52433135543	1.4750 % HITTFP 1.475 01/18/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.75%	169'490.00	0.02	a)
X52433139966	0.9250 % UCGIM 0.925 01/18/28 EMTN	350	0	0	350 EUR	92.24%	322'826.00	0.04	a)
X52433141947	1.6250 % UCGIM 1 5/8 01/18/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	84.94%	169'888.00	0.02	a)
X52433206740	0.9430 % MQGAU 0.943 01/19/29	150	0	0	150 EUR	87.77%	131'659.50	0.02	a)
X52433211310	0.7500 % SRGIM 0 3/4 06/20/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	86.14%	215'357.50	0.03	a)
X52433226854	1.2500 % SRGIM 1 1/4 06/20/34 EMTN	150	0	0	150 EUR	78.49%	117'727.50	0.02	a)
X52433244089	0.1250 % EOANGR 0 1/8 01/18/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	94.12%	376'476.00	0.05	a)
X52433244246	0.8750 % EOANGR 0 7/8 10/18/34 EMTN	300	0	0	300 EUR	77.02%	231'045.00	0.03	a)
X52434506320	1.0000 % RABOBK 1 01/19/34 GMTN	0	300	0	300 EUR	77.97%	233'922.00	0.03	a)
X52434701616	1.6250 % ATOSTR 1 5/8 01/25/28 EMTN	140	0	0	140 EUR	91.93%	128'696.40	0.02	a)
X52434702424	0.6250 % CABKSM 0 5/8 01/21/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	91.79%	183'582.00	0.03	a)
X52434702853	2.2500 % ATOSTR 2 1/4 01/25/32 EMTN	150	0	0	150 EUR	86.00%	128'998.50	0.02	a)
X52434710872	1.0540 % NGGLN 1.054 01/20/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	83.01%	166'012.00	0.02	a)
X52434787235	1.2500 % ABNAV 1 1/4 01/20/34 EMTN	300	0	0	300 EUR	79.60%	238'797.00	0.03	a)
X52435603571	0.6250 % HEIBOS 0 5/8 07/24/25 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52435611244	1.3750 % HEIBOS 1 3/8 07/24/28 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52436807866	0.8750 % PTHREE 0 7/8 01/26/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	93.92%	140'886.00	0.02	a)
X52436807940	1.6250 % PTHREE 1 5/8 01/26/29 EMTN	150	0	0	150 EUR	87.63%	131'448.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2436853035	0.6250 % OPBANK 0 5/8 07/27/27 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2437854487	2.3750 % TRNIM 2 3/8 PERP	250	0	0	250 EUR	91.14%	227'847.50	0.03	a)
XS2438026366	1.2500 % THAMES 1 1/4 01/31/32 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2438026440	0.8750 % THAMES 0 7/8 01/31/28	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2438615606	0.2500 % VW 0 1/4 01/31/25 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2438616240	0.8750 % VW 0 7/8 01/31/28 EMTN	250	250	250	250 EUR	89.81%	224'532.50	0.03	a)
XS2439004412	1.0000 % PLD 1 02/08/29 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2439004685	1.5000 % PLD 1 1/2 02/08/34	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2440678915	0.6250 % VLVY 0 5/8 02/14/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	97.02%	97'018.00	0.01	a)
XS2440690456	0.7500 % ATCOA 0 3/4 02/08/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	81.97%	163'930.00	0.02	a)
XS2441244535	0.7500 % NOVOB 0 3/4 03/31/25 EMTN	150	0	0	150 EUR	96.85%	145'276.50	0.02	a)
XS2441247041	1.3750 % NOVOB 1 3/8 03/31/30 EMTN	150	0	0	150 EUR	90.81%	136'213.50	0.02	a)
XS2441296923	0.5000 % SCBNOR 0 1/2 08/11/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	95.22%	190'432.00	0.03	a)
XS2441552192	1.2500 % GS 1 1/4 02/07/29 EMTN	350	0	0	350 EUR	88.88%	311'090.50	0.04	a)
XS2441574089	1.1250 % ERICB 1 1/8 02/08/27 EMTN	200	100	0	300 EUR	91.69%	275'058.00	0.04	a)
XS2442764747	0.8750 % IBM 0 7/8 02/09/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	86.38%	172'766.00	0.02	a)
XS2442765124	1.2500 % IBM 1 1/4 02/09/34 EMTN	300	0	0	300 EUR	81.25%	243'738.00	0.03	a)
XS2442768227	0.7500 % SEB 0 3/4 08/09/27 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2443438051	1.3750 % DANBNK 1 3/8 02/17/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.87%	189'746.00	0.03	a)
XS2443485565	1.3000 % SWEDA 1.3 02/17/27 GMTN	200	0	0	200 EUR	92.56%	185'120.00	0.03	a)
XS2443749648	2.7500 % TELIAS 2 3/4 06/30/2083	200	0	0	200 EUR	92.75%	185'500.00	0.03	a)
XS2443893255	1.1250 % NDAFH 1 1/8 02/16/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	92.98%	278'952.00	0.04	a)
XS2443920249	1.2500 % INTNED 1 1/4 02/16/27 GMTN	500	0	0	500 EUR	94.79%	473'935.00	0.07	a)
XS2443920751	1.7500 % INTNED 1 3/4 02/16/31	500	0	0	500 EUR	88.50%	442'510.00	0.06	a)
XS2443921056	0.6250 % IFXGR 0 5/8 02/17/25	100	0	0	100 EUR	97.04%	97'042.00	0.01	a)
XS2444263102	1.5600 % EXPNLN 1.56 05/16/31 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2444424639	1.0000 % GM 1 02/24/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.19%	194'378.00	0.03	a)
XS2445374213	1.2060 % BJASST 1.206 02/23/25	300	0	0	300 EUR	96.26%	288'783.00	0.04	a)
XS2446386356	2.1030 % MS 2.103 05/08/26	500	0	0	500 EUR	97.92%	489'585.00	0.07	a)
XS2446386430	2.9500 % MS 2.95 05/07/32 GMTN	500	0	0	500 EUR	93.80%	469'010.00	0.06	a)
XS2446843430	0.6250 % SIEGR 0 5/8 02/25/27 EMTN	100	0	0	100 EUR	92.54%	92'537.00	0.01	a)
XS2446844594	1.0000 % SIEGR 1 02/25/30	100	200	0	300 EUR	87.84%	263'529.00	0.04	a)
XS2446846888	1.2500 % SIEGR 1 1/4 02/25/35 EMTN	200	0	0	200 EUR	80.32%	160'646.00	0.02	a)
XS2447561403	0.5000 % BMW 0 1/2 02/22/25 EMTN	150	0	0	150 EUR	97.00%	145'495.50	0.02	a)
XS2447564332	1.0000 % BMW 1 05/22/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	91.20%	228'000.00	0.03	a)
XS2447983813	1.3750 % SHBASS 1 3/8 02/23/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	89.97%	269'907.00	0.04	a)
XS2448001813	1.0990 % WSTPNZ 1.099 03/24/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.60%	236'502.50	0.03	a)
XS2448014808	1.0000 % MA 1 02/22/29	350	0	0	350 EUR	90.07%	315'227.50	0.04	a)
XS2449330179	1.1250 % NOVOB 1 1/8 09/30/27 EMTN	150	0	0	150 EUR	93.10%	139'648.50	0.02	a)
XS2449911143	1.3750 % NWG 1 3/8 03/02/27 EMTN	350	0	0	350 EUR	93.62%	327'666.50	0.04	a)
XS2449928543	1.5000 % VWSDC 1 1/2 06/15/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.34%	180'686.00	0.02	a)
XS2449929517	2.0000 % VWSDC 2 06/15/34 EMTN	200	0	0	200 EUR	85.45%	170'898.00	0.02	a)
XS2450200741	1.2500 % UNANA 1 1/4 02/28/31 EMTN	250	0	0	250 EUR	87.61%	219'032.50	0.03	a)
XS2450200824	0.7500 % UNANA 0 3/4 02/28/26 EMTN	150	0	0	150 EUR	95.18%	142'773.00	0.02	a)
XS2451372499	1.2500 % ALDFP 1 1/4 03/02/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.62%	189'240.00	0.03	a)
XS2452433910	1.3750 % BSX 1 3/8 03/08/28	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2452434645	1.6250 % BSX 1 5/8 03/08/31	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2452435295	1.8750 % BSX 1 7/8 03/08/34	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2454766473	0.7500 % BSX 0 3/4 03/08/25	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2455983861	1.3750 % IBESM 1 3/8 03/11/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	86.40%	259'203.00	0.04	a)
XS2456247605	0.7500 % BASGR 0 3/4 03/17/26 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.64%	283'914.00	0.04	a)
XS2456247787	1.5000 % BASGR 1 1/2 03/17/31	100	0	0	100 EUR	87.51%	87'505.00	0.01	a)
XS2457496359	1.5000 % AEMSPA 1 1/2 03/16/28 EMTN	150	0	0	150 EUR	92.13%	138'189.00	0.02	a)
XS2458285355	1.3750 % DSVDC 1 3/8 03/16/30 EMTN	180	0	0	180 EUR	88.50%	159'298.20	0.02	a)
XS2459163619	1.7500 % LXSGR 1 3/4 03/22/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	90.85%	272'562.00	0.04	a)
XS2459544339	1.8750 % EDPPL 1 7/8 09/21/29 EMTN	400	0	0	400 EUR	91.48%	365'900.00	0.05	a)
XS2461234622	1.9630 % JPM 1.963 03/23/30 EMTN	0	900	0	900 EUR	91.79%	826'065.00	0.11	a)
XS2461785185	2.0000 % CASTSS 2 03/24/25 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.91%	193'810.00	0.03	a)
XS2462321212	0.8750 % NESNVX 0 7/8 03/29/27 EMTN	150	0	0	150 EUR	93.48%	140'221.50	0.02	a)
XS2462321303	1.2500 % NESNVX 1 1/4 03/29/31 EMTN	250	0	0	250 EUR	87.94%	219'847.50	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2462321485	1.5000 % NESNVX 1 1/2 03/29/35 EMTN	250	0	0	250 EUR	83.12%	207'810.00	0.03	a)
XS2462323853	2.8240 % BAC 2.824 04/27/33 EMTN	550	0	550	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2462324232	1.9490 % BAC 1.949 10/27/26 EMTN	600	0	600	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2462324745	1.2500 % HLNLN 1 1/4 03/29/26 EMTN	350	0	0	350 EUR	95.24%	333'333.00	0.05	a)
XS2462324828	1.7500 % HLNLN 1 3/4 03/29/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	89.69%	179'372.00	0.02	a)
XS2462325122	2.1250 % HLNLN 2 1/8 03/29/34 EMTN	250	0	0	250 EUR	86.00%	214'987.50	0.03	a)
XS2462466611	1.5000 % AKZANA 1 1/2 03/28/28 EMTN	250	0	0	250 EUR	92.23%	230'575.00	0.03	a)
XS2462468740	2.0000 % AKZANA 2 03/28/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	88.29%	176'570.00	0.02	a)
XS2463505581	0.8750 % EOANGR 0 7/8 01/08/25 EMTN	500	0	0	500 EUR	97.61%	488'040.00	0.07	a)
XS2463518998	1.6250 % EOANGR 1 5/8 03/29/31 EMTN	450	0	0	450 EUR	88.58%	398'601.00	0.05	a)
XS2463934864	2.6250 % TVOYFH 2 5/8 03/31/27 EMTN	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2463961248	1.3750 % LIN 1 3/8 03/31/31 EMTN	0	300	0	300 EUR	87.66%	262'980.00	0.04	a)
XS2463961677	1.6250 % LIN 1 5/8 03/31/35	0	200	0	200 EUR	82.60%	165'196.00	0.02	a)
XS2464405229	2.2500 % AIB 2 1/4 04/04/28 EMTN	350	0	0	350 EUR	95.15%	333'039.00	0.05	a)
XS2464732770	2.7500 % STLA 2 3/4 04/01/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.18%	184'362.00	0.03	a)
XS2465984107	1.6310 % MIZUHO 1.631 04/08/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	93.76%	187'516.00	0.03	a)
XS2465984289	1.8750 % BKIR 1 7/8 06/05/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	97.38%	389'512.00	0.05	a)
XS2465984529	2.0960 % MIZUHO 2.096 04/08/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	88.32%	176'630.00	0.02	a)
XS2466172363	1.6250 % DTRGR 1 5/8 04/06/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.42%	188'842.00	0.03	a)
XS2466350993	1.9520 % TD 1.952 04/08/30 EMTN	500	0	0	500 EUR	90.98%	454'905.00	0.06	a)
XS2466358111	1.1250 % CADEPO 1 1/8 04/06/27 REGS	600	0	0	600 EUR	94.00%	563'994.00	0.08	a)
XS2466368938	1.5000 % DGELN 1 1/2 06/08/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	91.16%	227'887.50	0.03	a)
XS2466401572	1.8750 % DGELN 1 7/8 06/08/34	300	0	0	300 EUR	85.69%	257'076.00	0.04	a)
XS2468223107	5.8000 % ASSGEN 5.8 07/06/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	106.94%	213'876.00	0.03	a)
XS2468378059	1.6250 % CABKSM 1 5/8 04/13/26 GMTN	200	200	0	400 EUR	97.44%	389'740.00	0.05	a)
XS2468979302	3.1250 % CETIN 3 1/8 04/14/27 EMTN	0	250	0	250 EUR	96.78%	241'945.00	0.03	a)
XS2472603740	2.1250 % RY 2 1/8 04/26/29 EMTN	400	0	0	400 EUR	92.95%	371'796.00	0.05	a)
XS2472845911	1.7500 % SPOLNO 1 3/4 04/27/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	94.15%	188'290.00	0.03	a)
XS2473346299	2.0000 % NWISE 2 04/28/27	200	0	0	200 EUR	95.18%	190'358.00	0.03	a)
XS2473687106	2.2500 % ASML 2 1/4 05/17/32	200	0	0	200 EUR	93.89%	187'784.00	0.03	a)
XS2473715675	2.7500 % BMO 2 3/4 06/15/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.67%	244'185.00	0.03	a)
XS2475513953	1.8500 % ONTFFT 1.85 05/03/32 REGS	400	0	0	400 EUR	89.53%	358'112.00	0.05	a)
XS2475919663	2.5000 % ELTLX 2 1/2 05/18/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.13%	180'250.00	0.02	a)
XS2475954579	1.8750 % PHIANA 1 7/8 05/05/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.18%	235'445.00	0.03	a)
XS2475955543	2.6250 % PHIANA 2 5/8 05/05/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	87.91%	175'810.00	0.02	a)
XS2475958059	2.1250 % PHIANA 2 1/8 11/05/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	90.41%	180'828.00	0.02	a)
XS2477935345	1.6250 % TENN 1 5/8 11/17/26 EMTN	350	0	350	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2478299204	2.1250 % TENN 2 1/8 11/17/29 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2478299469	2.7500 % TENN 2 3/4 05/17/42 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2478685931	2.2500 % UPMFH 2 1/4 05/23/29 EMTN	150	0	0	150 EUR	93.73%	140'589.00	0.02	a)
XS2478690931	1.7500 % SEB 1 3/4 11/11/26 GMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2479941499	1.5000 % V 1 1/2 06/15/26	0	500	0	500 EUR	95.63%	478'130.00	0.07	a)
XS2479941572	2.0000 % V 2 06/15/29	0	400	0	400 EUR	93.74%	374'952.00	0.05	a)
XS2479942034	2.3750 % V 2 3/8 06/15/34	0	200	0	200 EUR	91.61%	183'226.00	0.03	a)
XS2480515662	2.1250 % WURTH 2 1/8 08/23/30	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2480958904	1.6250 % VLVY 1 5/8 09/18/25 EMTN	100	0	0	100 EUR	96.75%	96'749.00	0.01	a)
XS2481287634	2.7500 % INVSA 2 3/4 06/10/32	0	200	0	200 EUR	94.81%	189'612.00	0.03	a)
XS2481287808	2.2500 % COLOBD 2 1/4 05/19/27 EMTN	270	0	270	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2481288525	2.7500 % COLOBD 2 3/4 05/19/30 EMTN	230	0	230	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2481498173	1.7500 % UNANA 1 3/4 11/16/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	93.63%	93'634.00	0.01	a)
XS2481498256	2.2500 % UNANA 2 1/4 05/16/34 EMTN	300	0	0	300 EUR	90.90%	272'697.00	0.04	a)
XS2482618464	2.5000 % NDAFH 2 1/2 05/23/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.49%	283'473.00	0.04	a)
XS2482872251	2.8750 % FREGR 2 7/8 05/24/30 EMTN	150	0	0	150 EUR	94.06%	141'093.00	0.02	a)
XS2483607474	2.1250 % INTNED 2 1/8 05/23/26 EMTN	400	0	0	400 EUR	97.79%	391'172.00	0.05	a)
XS2484111047	2.1250 % NAB 2 1/8 05/24/28 GMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2484340075	2.7500 % PPG 2 3/4 06/01/29	0	250	0	250 EUR	95.92%	239'810.00	0.03	a)
XS2484586669	1.7500 % MET 1 3/4 05/25/25 EMTN	150	0	0	150 EUR	97.43%	146'140.50	0.02	a)
XS2484587048	2.5920 % TELEFO 2.592 05/25/31 EMTN	100	200	0	300 EUR	94.15%	282'450.00	0.04	a)
XS2485152362	2.1000 % SWEDA 2.1 05/25/27 EMTN	250	0	0	250 EUR	95.47%	238'685.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
X52485259241	1.7500 % BBVASM 1 3/4 11/26/25 GMTN	400	0	0	400 EUR	96.81%	387'252.00	0.05	a)
X52485265214	3.1250 % PRIFI 3 1/8 06/01/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.09%	188'180.00	0.03	a)
X52485360981	2.5000 % HERIM 2 1/2 05/25/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	94.88%	284'643.00	0.04	a)
X52486092492	1.6250 % DNBNO 1 5/8 05/31/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.35%	243'380.00	0.03	a)
X52486285294	2.3750 % MCD 2 3/8 05/31/29 GMTN	0	400	0	400 EUR	94.39%	377'568.00	0.05	a)
X52486285377	3.0000 % MCD 3 05/31/34 GMTN	0	100	0	100 EUR	94.12%	94'122.00	0.01	a)
X52486461523	3.2450 % NGGLN 3.245 03/30/34 EMTN	200	0	0	200 EUR	92.98%	185'964.00	0.03	a)
X52486589596	3.0190 % HSBC 3.019 06/15/27	600	0	0	600 EUR	97.96%	587'772.00	0.08	a)
X52486839298	2.3750 % ALCSW 2 3/8 05/31/28	0	200	0	200 EUR	95.83%	191'666.00	0.03	a)
X52486857431	3.2500 % SHBASS 3 1/4 06/01/33	0	200	0	200 EUR	95.27%	190'532.00	0.03	a)
X52487016250	2.3750 % STEDIN 2 3/8 06/03/30 EMTN	0	150	0	150 EUR	93.48%	140'212.50	0.02	a)
X52487052487	4.2500 % AXASA 4 1/4 03/10/43 EMTN	300	100	0	400 EUR	97.06%	388'240.00	0.05	a)
X52487054004	2.3750 % ABNAV 2 3/8 06/01/27 EMTN	100	100	0	200 EUR	96.26%	192'518.00	0.03	a)
X52487054939	3.0000 % ABNAV 3 06/01/32 EMTN	200	100	0	300 EUR	96.21%	288'615.00	0.04	a)
X52487667276	2.8850 % BACR 2.885 01/31/27 EMTN	0	150	0	150 EUR	98.06%	147'094.50	0.02	a)
X52488809612	4.3750 % NOKIA 4 3/8 08/21/31 EMTN	0	170	0	170 EUR	99.50%	169'153.40	0.02	a)
X52489138789	3.2500 % URENCO 3 1/4 06/13/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.63%	195'268.00	0.03	a)
X52489287354	2.1250 % SANDSS 2 1/8 06/07/27 EMTN	150	0	0	150 EUR	95.60%	143'394.00	0.02	a)
X52489772991	4.5000 % HESLAN 4 1/2 09/15/32 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52489775580	3.5000 % SESGFP 3 1/2 01/14/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	97.00%	290'988.00	0.04	a)
X52489982293	3.5560 % MUFG 3.556 06/15/32 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.18%	300'543.00	0.04	a)
X52490472102	2.8750 % ORSTED 2 7/8 06/14/33 EMTN	250	0	0	250 EUR	92.63%	231'565.00	0.03	a)
X52491029380	2.3750 % MRKGR 2 3/8 06/15/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	94.63%	189'254.00	0.03	a)
X52491542374	3.1250 % BASGR 3 1/8 06/29/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	99.17%	198'332.00	0.03	a)
X52491542457	3.7500 % BASGR 3 3/4 06/29/32 EMTN	100	0	0	100 EUR	100.40%	100'399.00	0.01	a)
X52491664137	4.0000 % ERFFP 4 07/06/29	200	0	0	200 EUR	98.83%	197'664.00	0.03	a)
X52491738949	3.7500 % VW 3 3/4 09/28/27	0	300	0	300 EUR	100.15%	300'462.00	0.04	a)
X52491963638	3.6250 % AIB 3 5/8 07/04/26	200	0	0	200 EUR	99.68%	199'368.00	0.03	a)
X52494945939	3.8750 % RTOLN 3 7/8 06/27/27 EMTN	300	0	0	300 EUR	100.26%	300'768.00	0.04	a)
X52494946820	4.3750 % RTOLN 4 3/8 06/27/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	103.01%	206'028.00	0.03	a)
X52495084621	5.6250 % CESDRA 5 5/8 10/12/27	0	200	0	200 EUR	105.49%	210'982.00	0.03	a)
X52496028502	2.7500 % BRITEL 2 3/4 08/30/27 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52496028924	3.3750 % BRITEL 3 3/8 08/30/32 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52497520887	5.3370 % CE 5.337 01/19/29	0	200	0	200 EUR	103.91%	207'810.00	0.03	a)
X52498554992	4.0000 % ALDFP 4 07/05/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	100.26%	200'516.00	0.03	a)
X52502220929	4.3750 % AMCOSP 4 3/8 03/27/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.28%	200'564.00	0.03	a)
X52511301322	2.5510 % TD 2.551 08/03/27 EMTN	235	0	0	235 EUR	96.72%	227'282.60	0.03	a)
X52511309903	3.1290 % TD 3.129 08/03/32 EMTN	350	0	0	350 EUR	96.17%	336'605.50	0.05	a)
X52511906310	3.7500 % SEGPLP 3 3/4 08/10/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.96%	197'910.00	0.03	a)
X52517103334	2.6250 % SGOFF 2 5/8 08/10/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	93.40%	186'800.00	0.03	a)
X52517103417	2.1250 % SGOFF 2 1/8 06/10/28 EMTN	100	0	0	100 EUR	94.83%	94'826.00	0.01	a)
X52521013909	3.6250 % CNUNZ 3 5/8 09/07/29 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52521027446	3.1250 % LLOYDS 3 1/8 08/24/30 EMTN	250	100	0	350 EUR	95.91%	335'692.00	0.05	a)
X52521820048	2.0000 % VLVY 2 08/19/27 EMTN	150	0	0	150 EUR	95.08%	142'624.50	0.02	a)
X52522879654	3.6250 % SWEDA 3 5/8 08/23/32 GMTN	200	0	0	200 EUR	96.55%	193'094.00	0.03	a)
X52524143554	3.8750 % RABOBK 3 7/8 11/30/32 GMTN	200	0	0	200 EUR	98.35%	196'692.00	0.03	a)
X52524740649	2.8750 % NDAFH 2 7/8 08/24/32 EMTN	250	0	0	250 EUR	94.61%	236'517.50	0.03	a)
X52524746687	4.1250 % INTNED 4 1/8 08/24/33	300	0	0	300 EUR	98.09%	294'273.00	0.04	a)
X52525226622	3.5300 % SANUK 3.53 08/25/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	98.28%	196'566.00	0.03	a)
X52525246901	3.2500 % NWIDE 3 1/4 09/05/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	98.19%	245'467.50	0.03	a)
X52526486159	5.2500 % NNGRNV 5 1/4 03/01/43 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.31%	101'314.00	0.01	a)
X52526828996	2.8750 % EOANGR 2 7/8 08/26/28 EMTN	350	0	0	350 EUR	98.20%	343'682.50	0.05	a)
X52526839258	2.5000 % SIEGR 2 1/2 09/08/27 EMTN	100	100	0	200 EUR	97.48%	194'952.00	0.03	a)
X52526839506	3.0000 % SIEGR 3 09/08/33 EMTN	300	0	0	300 EUR	96.90%	290'697.00	0.04	a)
X52526839761	2.7500 % SIEGR 2 3/4 09/09/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	96.82%	193'636.00	0.03	a)
X52527421668	3.0000 % JCI 3 09/15/28	200	0	0	200 EUR	97.96%	195'924.00	0.03	a)
X52527451905	2.6250 % SHBASS 2 5/8 09/05/29	0	200	0	200 EUR	96.24%	192'484.00	0.03	a)
X52527786755	2.1250 % VLVY 2 1/8 09/01/24 EMTN	150	0	0	150 EUR	99.09%	148'641.00	0.02	a)
X52528311348	4.0290 % MIZUHO 4.029 09/05/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.23%	202'458.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2528323780	3.4900 % MIZUHO 3.49 09/05/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	98.97%	296'913.00	0.04	a)
XS2528582377	3.0000 % CPGLN 3 03/08/30 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.67%	195'334.00	0.03	a)
XS2528858033	4.0670 % NWG 4.067 09/06/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	100.58%	301'749.00	0.04	a)
XS2529233814	4.7500 % ISPIM 4 3/4 09/06/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	102.51%	205'024.00	0.03	a)
XS2529520715	3.6250 % PRIFI 3 5/8 03/07/30 EMTN	100	100	0	200 EUR	98.39%	196'780.00	0.03	a)
XS2530034649	3.7500 % CABKSM 3 3/4 09/07/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	100.97%	201'934.00	0.03	a)
XS2530219349	2.6250 % HENKEL 2 5/8 09/13/27	200	0	0	200 EUR	97.84%	195'682.00	0.03	a)
XS2530444624	3.8750 % FMEGR 3 7/8 09/20/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	99.88%	299'634.00	0.04	a)
XS2530756191	3.0000 % WKLNA 3 09/23/26	0	200	0	200 EUR	98.87%	197'742.00	0.03	a)
XS2531420656	3.8750 % ENELIM 3 7/8 03/09/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.35%	202'696.00	0.03	a)
XS2531420730	2.6250 % ALLRNV 2 5/8 09/09/27 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2531438351	2.5000 % DE 2 1/2 09/14/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.79%	195'578.00	0.03	a)
XS2531479462	4.1250 % BAWAG 4 1/8 01/18/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.84%	199'678.00	0.03	a)
XS2531569965	3.2500 % ORSTED 3 1/4 09/13/31 EMTN	300	0	0	300 EUR	97.06%	291'186.00	0.04	a)
XS2532312548	2.8750 % STATK 2 7/8 09/13/29 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.72%	244'287.50	0.03	a)
XS2534276717	2.6250 % VLVY 2 5/8 02/20/26 EMTN	250	0	0	250 EUR	97.94%	244'845.00	0.03	a)
XS2534785865	3.3750 % BBVASM 3 3/8 09/20/27 GMTN	400	0	0	400 EUR	99.45%	397'796.00	0.05	a)
XS2534786590	7.3750 % RBAIV 7 3/8 12/20/32	100	0	0	100 EUR	104.80%	104'795.00	0.01	a)
XS2534891978	3.2500 % KNOGR 3 1/4 09/21/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	99.02%	198'044.00	0.03	a)
XS2534976886	4.5000 % AEMSPA 4 1/2 09/19/30 EMTN	100	0	0	100 EUR	103.13%	103'132.00	0.01	a)
XS2534985523	3.1250 % DNBNO 3 1/8 09/21/27 EMTN	200	200	0	400 EUR	98.50%	394'016.00	0.05	a)
XS2535307743	2.6250 % MDT 2 5/8 10/15/25	100	0	0	100 EUR	97.95%	97'950.00	0.01	a)
XS2535308477	3.0000 % MDT 3 10/15/28	350	0	0	350 EUR	98.15%	343'514.50	0.05	a)
XS2535308634	3.1250 % MDT 3 1/8 10/15/31	350	0	0	350 EUR	97.51%	341'288.50	0.05	a)
XS2535309798	3.3750 % MDT 3 3/8 10/15/34	300	0	0	300 EUR	97.69%	293'079.00	0.04	a)
XS2535724772	4.0000 % VGASDE 4 09/26/27 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2535725159	4.6250 % VGASDE 4 5/8 09/26/32 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2536362622	4.1120 % C 4.112 09/22/33	300	0	0	300 EUR	101.49%	304'464.00	0.04	a)
XS2536364081	3.7130 % C 3.713 09/22/28	300	0	0	300 EUR	99.89%	299'661.00	0.04	a)
XS2536431617	4.7500 % AALLN 4 3/4 09/21/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	104.05%	208'104.00	0.03	a)
XS2536502227	4.0000 % GS 4 09/21/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	101.39%	304'170.00	0.04	a)
XS2536941656	4.2500 % ABNANV 4 1/4 02/21/30 EMTN	400	0	0	400 EUR	102.65%	410'612.00	0.06	a)
XS2537251170	3.7500 % AXASA 3 3/4 10/12/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	102.81%	257'022.50	0.04	a)
XS2538366878	3.6250 % SANTAN 3 5/8 09/27/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	99.53%	199'056.00	0.03	a)
XS2538368221	3.7500 % SANDSS 3 3/4 09/27/29 EMTN	150	0	0	150 EUR	100.82%	151'230.00	0.02	a)
XS2539371653	3.3000 % ONTTFT 3.3 10/05/29 REGS	0	160	0	160 EUR	100.02%	160'028.80	0.02	a)
XS2540585564	4.1250 % ELTLX 4 1/8 10/05/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	99.93%	199'860.00	0.03	a)
XS2542914986	3.8750 % EDPPL 3 7/8 03/11/30 EMTN	0	150	0	150 EUR	101.36%	152'044.50	0.02	a)
XS2544400786	4.6250 % JYBC 4 5/8 04/11/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.53%	201'050.00	0.03	a)
XS2545206166	4.3750 % BBVASM 4 3/8 10/14/29 GMTN	400	0	0	400 EUR	104.09%	416'348.00	0.06	a)
XS2545248242	3.7500 % VATFAL 3 3/4 10/18/26 EMTN	100	0	0	100 EUR	100.38%	100'384.00	0.01	a)
XS2545259876	4.5000 % DELL 4 1/2 10/18/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	102.25%	204'500.00	0.03	a)
XS2545263399	3.2500 % CARLB 3 1/4 10/12/25 EMTN	150	0	0	150 EUR	99.15%	148'726.50	0.02	a)
XS2545759099	5.2500 % ISPIM 5 1/4 01/13/30 EMTN	250	0	0	250 EUR	106.80%	267'007.50	0.04	a)
XS2546781555	4.1250 % OPBANK 4 1/8 04/18/27 EMTN	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2547609433	4.0000 % TALANX 4 10/25/29 EMTN	200	200	200	200 EUR	101.73%	203'464.00	0.03	a)
XS2547936984	5.7500 % RBAIV 5 3/4 01/27/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	105.90%	211'800.00	0.03	a)
XS2548080832	4.8130 % MS 4.813 10/25/28	350	0	0	350 EUR	103.33%	361'641.00	0.05	a)
XS2548081053	5.1480 % MS 5.148 01/25/34 GMTN	600	0	0	600 EUR	108.09%	648'516.00	0.09	a)
XS2549543143	3.8750 % TENN 3 7/8 10/28/28 EMTN	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2549543226	4.2500 % TENN 4 1/4 04/28/32 EMTN	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2549543499	4.5000 % TENN 4 1/2 10/28/34 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2549715618	4.7500 % TENN 4 3/4 10/28/42 EMTN	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2549815913	5.8750 % HANRUE 5 7/8 08/26/43	200	500	0	700 EUR	109.45%	766'164.00	0.11	a)
XS2550081454	4.6250 % RABOBK 4 5/8 01/27/28 GMTN	300	0	0	300 EUR	102.34%	307'011.00	0.04	a)
XS2550881143	4.2500 % VZ 4 1/4 10/31/30	0	400	0	400 EUR	103.29%	413'176.00	0.06	a)
XS2550898204	4.7500 % VZ 4 3/4 10/31/34	0	400	0	400 EUR	107.46%	429'856.00	0.06	a)
XS2550909415	4.0000 % ESBIRE 4 05/03/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	102.70%	205'400.00	0.03	a)
XS2551280436	3.7500 % SHBASS 3 3/4 11/01/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.03%	303'093.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2552362704	4.7000 % GWOCN 4.7 11/16/29	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2553547444	6.3640 % HSBC 6.364 11/16/32	300	0	0	300 EUR	105.60%	316'803.00	0.04 a)	
XS2553798443	4.0000 % SEB 4 11/09/26	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2553801502	5.1250 % SABS5M 5 1/8 11/10/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	104.22%	208'434.00	0.03 a)	
XS2553817680	3.0000 % GSK 3 11/28/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	98.91%	197'818.00	0.03 a)	
XS2553817763	3.1250 % GSK 3 1/8 11/28/32 EMTN	200	0	0	200 EUR	97.25%	194'492.00	0.03 a)	
XS2554488978	4.2500 % VW 4 1/4 02/15/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.62%	203'246.00	0.03 a)	
XS2554489513	4.3750 % VW 4 3/8 05/15/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.04%	206'082.00	0.03 a)	
XS2554581830	7.0000 % ASRND 7 12/07/43	250	0	0	250 EUR	112.05%	280'135.00	0.04 a)	
XS2554745708	5.2500 % INTNED 5 1/4 11/14/33	300	0	0	300 EUR	108.96%	326'883.00	0.04 a)	
XS2554746185	4.8750 % INTNED 4 7/8 11/14/27 EMTN	200	200	0	400 EUR	102.43%	409'732.00	0.06 a)	
XS2554997937	4.7500 % COVEGR 4 3/4 11/15/28 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2555178644	3.0000 % ADSGR 3 11/21/25	100	0	0	100 EUR	99.14%	99'142.00	0.01 a)	
XS2555179378	3.1250 % ADSGR 3 1/8 11/21/29	100	200	0	300 EUR	99.20%	297'612.00	0.04 a)	
XS2555187801	5.3750 % CABKSM 5 3/8 11/14/30 EMTN	300	0	0	300 EUR	106.82%	320'445.00	0.04 a)	
XS2555192710	3.7500 % SWEDA 3 3/4 11/14/25 EMTN	150	100	0	250 EUR	99.96%	249'897.50	0.03 a)	
XS2555196463	3.0000 % NESNVX 3 03/15/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	99.89%	199'788.00	0.03 a)	
XS2555198089	3.2500 % NESNVX 3 1/4 01/15/31 EMTN	200	0	0	200 EUR	100.29%	200'578.00	0.03 a)	
XS2555198162	3.3750 % NESNVX 3 3/8 11/15/34 EMTN	150	0	0	150 EUR	101.29%	151'932.00	0.02 a)	
XS2555218291	4.0000 % BKNG 4 11/15/26	0	300	0	300 EUR	101.12%	303'357.00	0.04 a)	
XS2555220867	4.2500 % BKNG 4 1/4 05/15/29	0	200	0	200 EUR	102.96%	205'926.00	0.03 a)	
XS2555220941	4.5000 % BKNG 4 1/2 11/15/31	0	350	0	350 EUR	105.49%	369'215.00	0.05 a)	
XS2555221246	4.7500 % BKNG 4 3/4 11/15/34	0	350	0	350 EUR	107.99%	377'979.00	0.05 a)	
XS2555412001	6.6930 % CESSPO 6.693 11/14/25 EMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2555420103	5.8500 % UCGIM 5.85 11/15/27 EMTN	500	0	0	500 EUR	104.60%	522'985.00	0.07 a)	
XS2555918270	5.5000 % JYBC 5 1/2 11/16/27	0	200	0	200 EUR	103.35%	206'698.00	0.03 a)	
XS2555925218	5.7500 % AIB 5 3/4 02/16/29	250	0	0	250 EUR	106.37%	265'930.00	0.04 a)	
XS2557084733	4.5000 % ABNAV 4 1/2 11/21/34	300	0	0	300 EUR	105.05%	315'156.00	0.04 a)	
XS2557526006	3.2000 % TMO 3.2 01/21/26	0	200	0	200 EUR	99.27%	198'536.00	0.03 a)	
XS2557526345	3.6500 % TMO 3.65 11/21/34	0	200	0	200 EUR	100.95%	201'892.00	0.03 a)	
XS2558022591	5.1250 % ABNAV 5 1/8 02/22/33 EMTN	300	0	0	300 EUR	101.51%	304'542.00	0.04 a)	
XS2558395278	4.0490 % ENBW 4.049 11/22/29 EMTN	200	0	0	200 EUR	102.86%	205'710.00	0.03 a)	
XS2558916693	3.1250 % IBESM 3 1/8 11/22/28 EMTN	200	0	0	200 EUR	99.25%	198'498.00	0.03 a)	
XS2558953621	3.2500 % SEB 3 1/4 11/24/25 GMTN	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2558966953	3.3750 % IBESM 3 3/8 11/22/32 EMTN	300	0	0	300 EUR	98.93%	296'784.00	0.04 a)	
XS2558972415	3.6250 % CONGR 3 5/8 11/30/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.09%	200'172.00	0.03 a)	
XS2558978883	6.2500 % CABKSM 6 1/4 02/23/33 EMTN	200	100	0	300 EUR	104.54%	313'608.00	0.04 a)	
XS2559453431	3.2500 % PCAR 3 1/4 11/29/25 EMTN	0	150	0	150 EUR	99.46%	149'185.50	0.02 a)	
XS2559501429	5.0000 % FREGR 5 11/28/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	104.33%	208'652.00	0.03 a)	
XS2559580548	4.2500 % FREGR 4 1/4 05/28/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	100.66%	201'318.00	0.03 a)	
XS2560328648	4.6250 % DNBNO 4 5/8 02/28/33 EMTN	200	0	0	200 EUR	100.51%	201'012.00	0.03 a)	
XS2560411543	3.6250 % ACHMEA 3 5/8 11/29/25	0	200	0	200 EUR	99.51%	199'018.00	0.03 a)	
XS2560422581	5.2620 % BACR 5.262 01/29/34 EMTN	0	400	0	400 EUR	105.59%	422'364.00	0.06 a)	
XS2560495116	3.7500 % VOD 3 3/4 12/02/34 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.12%	200'236.00	0.03 a)	
XS2560495462	3.2500 % VOD 3 1/4 03/02/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	98.96%	197'912.00	0.03 a)	
XS2560753936	3.5000 % BERTEL 3 1/2 05/29/29	300	0	0	300 EUR	99.48%	298'446.00	0.04 a)	
XS2561182622	6.7500 % BKIR 6 3/4 03/01/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	105.67%	211'346.00	0.03 a)	
XS2561647368	4.6250 % LIBMUT 4 5/8 12/02/30 REGS	200	0	0	200 EUR	101.97%	203'934.00	0.03 a)	
XS2561748711	3.7500 % MET 3 3/4 12/05/30 EMTN	200	100	0	300 EUR	100.90%	302'712.00	0.04 a)	
XS2563002653	4.6250 % BACRED 4 5/8 02/07/29 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2563353361	5.2500 % ORSTED 5 1/4 12/08/3022	0	100	0	100 EUR	100.88%	100'875.00	0.01 a)	
XS2565831943	3.6310 % TD 3.631 12/13/29 EMTN	350	0	0	350 EUR	99.92%	349'702.50	0.05 a)	
XS2569069375	4.5000 % LLOYDS 4 1/2 01/11/29 EMTN	0	100	0	100 EUR	102.13%	102'134.00	0.01 a)	
XS2572476864	3.6250 % NYLIFE 3 5/8 01/09/30 EMTN	100	150	0	250 EUR	100.95%	252'385.00	0.03 a)	
XS2572496623	4.2500 % SWEDA 4 1/4 07/11/28 GMTN	0	100	0	100 EUR	101.11%	101'112.00	0.01 a)	
XS2572989650	3.3750 % TOYOTA 3 3/8 01/13/26 EMTN	0	450	0	450 EUR	99.62%	448'303.50	0.06 a)	
XS2572989817	3.5000 % TOYOTA 3 1/2 01/13/28 EMTN	0	250	0	250 EUR	99.84%	249'610.00	0.03 a)	
XS2572996606	4.0000 % RABOBK 4 01/10/30 EMTN	0	400	0	400 EUR	101.55%	406'208.00	0.06 a)	
XS2573331324	3.6250 % ABNAV 3 5/8 01/10/26 EMTN	200	0	0	200 EUR	100.18%	200'362.00	0.03 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2573569220	4.0000 % DANBNK 4 01/12/27	0	300	0	300 EUR	100.21%	300'627.00	0.04	a)
XS2573569576	4.1250 % DANBNK 4 1/8 01/10/31	0	350	0	350 EUR	101.62%	355'663.00	0.05	a)
XS2573712044	4.6250 % BBVASM 4 5/8 01/13/31	0	300	0	300 EUR	103.53%	310'602.00	0.04	a)
XS2573807778	3.6250 % AXASA 3 5/8 01/10/33 EMTN	0	250	0	250 EUR	102.23%	255'562.50	0.04	a)
XS2574873183	3.8750 % EOANGR 3 7/8 01/12/35 EMTN	300	0	0	300 EUR	100.77%	302'304.00	0.04	a)
XS2574873266	3.5000 % EOANGR 3 1/2 01/12/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	100.50%	301'494.00	0.04	a)
XS2575555938	3.2500 % ABBNVX 3 1/4 01/16/27 EMTN	200	0	0	200 EUR	99.64%	199'280.00	0.03	a)
XS2575556589	3.3750 % ABBNVX 3 3/8 01/16/31 EMTN	100	0	0	100 EUR	100.18%	100'178.00	0.01	a)
XS2575952424	3.7500 % SANTAN 3 3/4 01/16/26 EMTN	400	100	0	500 EUR	100.08%	500'415.00	0.07	a)
XS2575952697	3.8750 % SANTAN 3 7/8 01/16/28 EMTN	400	0	0	400 EUR	100.42%	401'688.00	0.06	a)
XS2575952853	3.7030 % WSTP 3.703 01/16/26 EMTN	0	350	0	350 EUR	100.09%	350'315.00	0.05	a)
XS2575952937	3.7990 % WSTP 3.799 01/17/30 EMTN	150	0	0	150 EUR	101.51%	152'265.00	0.02	a)
XS2575965327	3.7500 % MASSMU 3 3/4 01/19/30 GMTN	100	200	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2575971994	4.0000 % ABNANV 4 01/16/28 EMTN	300	0	0	300 EUR	101.04%	303'129.00	0.04	a)
XS2575973776	3.8750 % NGGLN 3 7/8 01/16/29 EMTN	0	250	0	250 EUR	100.86%	252'140.00	0.03	a)
XS2576067081	4.2750 % NGGLN 4.275 01/16/35 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.75%	302'250.00	0.04	a)
XS2576245281	3.5000 % SGOPF 3 1/2 01/18/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.71%	199'428.00	0.03	a)
XS2576255249	4.2500 % NWG 4 1/4 01/13/28 EMTN	0	250	0	250 EUR	102.22%	255'555.00	0.04	a)
XS2576362839	4.8750 % BKIR 4 7/8 07/16/28	0	300	0	300 EUR	103.18%	309'525.00	0.04	a)
XS2576550086	6.3750 % ENELIM 6 3/8 PERP EMTN	0	300	0	300 EUR	104.99%	314'964.00	0.04	a)
XS2576550243	6.6250 % ENELIM 6 5/8 PERP EMTN	0	220	0	220 EUR	107.65%	236'825.60	0.03	a)
XS2576550326	4.0000 % THAMES 4 04/18/27 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2576550672	4.3750 % THAMES 4 3/8 01/18/31 EMTN	0	100	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2577033553	7.1250 % RABKAS 7 1/8 01/19/26 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2577053825	4.8000 % UCGIM 4.8 01/17/29 EMTN	300	0	0	300 EUR	103.12%	309'363.00	0.04	a)
XS2577054716	4.0000 % LFBANK 4 01/18/27 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2577127884	3.6520 % ANZ 3.652 01/20/26 EMTN	0	350	0	350 EUR	100.04%	350'133.00	0.05	a)
XS2577127967	5.1010 % ANZ 5.101 02/03/33 EMTN	0	350	0	350 EUR	102.08%	357'262.50	0.05	a)
XS2577384691	4.2500 % HITTFP 4 1/4 03/18/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.40%	202'794.00	0.03	a)
XS2577396430	4.2500 % PCIM 4 1/4 01/18/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.57%	203'144.00	0.03	a)
XS2579284469	3.8750 % ACEIM 3 7/8 01/24/31	0	300	0	300 EUR	99.57%	298'713.00	0.04	a)
XS2579293536	4.0000 % ENBW 4 01/24/35 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.48%	200'950.00	0.03	a)
XS2579293619	3.5000 % ENBW 3 1/2 07/24/28 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.41%	100'414.00	0.01	a)
XS2579324869	3.7500 % NACN 3 3/4 01/25/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.22%	200'448.00	0.03	a)
XS2579606927	4.7500 % RBIACV 4 3/4 01/26/27	0	300	0	300 EUR	100.74%	302'208.00	0.04	a)
XS2579897633	4.7500 % ATOSTR 4 3/4 01/24/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.36%	204'716.00	0.03	a)
XS2580221658	4.8750 % IBESM 4 7/8 PERP EMTN	0	200	0	200 EUR	100.44%	200'886.00	0.03	a)
XS2580271596	3.8750 % PLD 3 7/8 01/31/30 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2580271752	4.2500 % PLD 4 1/4 01/31/43 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2582195207	4.0000 % HESLAN 4 02/04/30 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2582814039	3.7500 % BRITEL 3 3/4 05/13/31 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2582860909	4.1250 % ABESM 4 1/8 08/07/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.53%	201'068.00	0.03	a)
XS2583205906	4.3750 % AEMSPA 4 3/8 02/03/34	0	150	0	150 EUR	101.84%	152'755.50	0.02	a)
XS2583211201	4.6250 % AMCOSP 4 5/8 02/06/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.26%	202'520.00	0.03	a)
XS2583352443	3.5000 % VLVY 3 1/2 11/17/25 EMTN	0	150	0	150 EUR	99.62%	149'422.50	0.02	a)
XS2583600791	3.7500 % SEB 3 3/4 02/07/28 GMTN	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2583644146	4.4770 % ORIX 4.477 06/01/28 EMTN	0	400	200	200 EUR	103.00%	206'004.00	0.03	a)
XS2583741934	3.3750 % IBM 3 3/8 02/06/27	0	200	0	200 EUR	99.86%	199'716.00	0.03	a)
XS2583742239	3.6250 % IBM 3 5/8 02/06/31	0	350	0	350 EUR	100.75%	352'625.00	0.05	a)
XS2583742585	3.7500 % IBM 3 3/4 02/06/35	0	320	0	320 EUR	100.88%	322'803.20	0.04	a)
XS2583742668	4.0000 % IBM 4 02/06/43	0	320	0	320 EUR	100.79%	322'515.20	0.04	a)
XS2584643113	3.6250 % NDAFH 3 5/8 02/10/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	99.55%	298'635.00	0.04	a)
XS2585239200	4.6250 % VMUKLN 4 5/8 10/29/28 GMTN	0	200	0	200 EUR	99.54%	199'080.00	0.03	a)
XS2585932275	3.5530 % BDX 3.553 09/13/29	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2586123965	4.8670 % F 4.867 08/03/27	0	300	0	300 EUR	102.03%	306'084.00	0.04	a)
XS2586779782	3.2500 % TEMASE 3 1/4 02/15/27 GMTN	0	250	0	250 EUR	99.54%	248'860.00	0.03	a)
XS2586780012	3.5000 % TEMASE 3 1/2 02/15/33 GMTN	0	200	0	200 EUR	100.69%	201'378.00	0.03	a)
XS2586851300	4.0000 % VOD 4 02/10/43 EMTN	0	150	0	150 EUR	99.21%	148'821.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
X52587306403	3.8200 % SGELN 3.82 02/15/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.89%	201'772.00	0.03	a)
X52587352340	4.3000 % GM 4.3 02/15/29 EMTN	0	250	0	250 EUR	102.12%	255'297.50	0.04	a)
X52588099478	3.6250 % DNBNO 3 5/8 02/16/27 EMTN	0	400	0	400 EUR	99.47%	397'888.00	0.05	a)
X52588099981	3.3750 % SHBASS 3 3/8 02/17/28	0	400	0	400 EUR	99.74%	398'940.00	0.05	a)
X52588885025	4.4500 % UCGIM 4.45 02/16/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.20%	303'585.00	0.04	a)
X52588986997	5.0000 % INTNED 5 02/20/35 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.21%	202'416.00	0.03	a)
X52589260723	4.0000 % ENELIM 4 02/20/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.75%	203'504.00	0.03	a)
X52589260996	4.5000 % ENELIM 4 1/2 02/20/43 EMTN	0	220	0	220 EUR	101.90%	224'177.80	0.03	a)
X52589361240	6.1840 % ISPIM 6.184 02/20/34 EMTN	0	300	0	300 EUR	104.18%	312'531.00	0.04	a)
X52589712996	4.1570 % MIZUHO 4.157 05/20/28 EMTN	0	250	0	250 EUR	101.39%	253'477.50	0.03	a)
X52589713614	4.4160 % MIZUHO 4.416 05/20/33 EMTN	0	250	0	250 EUR	103.60%	258'995.00	0.04	a)
X52589790018	3.6250 % SIEGR 3 5/8 02/24/43	0	300	0	300 EUR	98.80%	296'394.00	0.04	a)
X52589790109	3.3750 % SIEGR 3 3/8 08/24/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.16%	200'310.00	0.03	a)
X52589792220	3.5000 % SIEGR 3 1/2 02/24/36 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.85%	99'854.00	0.01	a)
X52589820294	4.6250 % PRIFII 4 5/8 02/21/35 EMTN	0	180	0	180 EUR	102.71%	184'869.00	0.03	a)
X52589828941	3.6250 % TELIAS 3 5/8 02/22/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.87%	201'736.00	0.03	a)
X52590758400	3.5500 % T 3.55 11/18/25	0	300	0	300 EUR	99.66%	298'971.00	0.04	a)
X52590758665	3.9500 % T 3.95 04/30/31	0	350	0	350 EUR	101.57%	355'491.50	0.05	a)
X52590758822	4.3000 % T 4.3 11/18/34	0	300	0	300 EUR	102.77%	308'295.00	0.04	a)
X52591026856	3.6250 % ORSTED 3 5/8 03/01/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.49%	198'980.00	0.03	a)
X52591029876	3.7500 % ORSTED 3 3/4 03/01/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.40%	200'806.00	0.03	a)
X52591032235	4.1250 % ORSTED 4 1/8 03/01/35 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.78%	203'558.00	0.03	a)
X52591848192	3.5000 % UNANA 3 1/2 02/23/35	0	150	0	150 EUR	100.52%	150'780.00	0.02	a)
X52592088236	3.2040 % ROSW 3.204 08/27/29	0	200	0	200 EUR	100.22%	200'430.00	0.03	a)
X52592088400	3.3550 % ROSW 3.355 02/27/35	0	200	0	200 EUR	100.09%	200'172.00	0.03	a)
X52592240712	4.8750 % DEVOPA 4 7/8 03/07/30	0	200	0	200 EUR	103.57%	207'134.00	0.03	a)
X52592516210	3.7500 % WKLNA 3 3/4 04/03/31	0	200	0	200 EUR	101.51%	203'028.00	0.03	a)
X52592628791	5.7630 % NWG 5.763 02/28/34 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.72%	207'440.00	0.03	a)
X52592650373	5.0000 % ISPIM 5 03/08/28 EMTN	0	550	0	550 EUR	102.96%	566'252.50	0.08	a)
X52592658947	5.6250 % ISPIM 5 5/8 03/08/33 EMTN	0	250	0	250 EUR	107.78%	269'460.00	0.04	a)
X52592659242	4.1250 % VFC 4 1/8 03/07/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	98.46%	196'918.00	0.03	a)
X52592659671	4.2500 % VFC 4 1/4 03/07/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	96.34%	192'686.00	0.03	a)
X52593105393	3.6250 % AZN 3 5/8 03/03/27 EMTN	0	250	0	250 EUR	100.77%	251'930.00	0.03	a)
X52593105476	3.7500 % AZN 3 3/4 03/03/32 EMTN	0	250	0	250 EUR	102.49%	256'212.50	0.04	a)
X52594025814	4.8750 % ARCAD 4 7/8 02/28/28	0	200	0	200 EUR	103.23%	206'468.00	0.03	a)
X52595028536	4.6560 % MS 4.656 03/02/29	0	500	0	500 EUR	102.71%	513'540.00	0.07	a)
X52595036554	4.0000 % APD 4 03/03/35	0	250	0	250 EUR	102.17%	255'415.00	0.04	a)
X52595410775	3.5000 % NESNVX 3 1/2 12/13/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.14%	202'276.00	0.03	a)
X52595412631	3.7500 % NESNVX 3 3/4 03/13/33 EMTN	0	300	0	300 EUR	103.92%	311'754.00	0.04	a)
X52595417945	4.2500 % MCD 4 1/4 03/07/35 GMTN	0	250	0	250 EUR	103.00%	257'505.00	0.04	a)
X52595418166	4.0000 % MCD 4 03/07/30 GMTN	0	250	0	250 EUR	101.93%	254'820.00	0.03	a)
X52595418323	4.0000 % BASGR 4 03/08/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.44%	204'888.00	0.03	a)
X52595418596	4.2500 % BASGR 4 1/4 03/08/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.92%	207'834.00	0.03	a)
X52595418679	4.5000 % BASGR 4 1/2 03/08/35 EMTN	0	200	0	200 EUR	105.34%	210'682.00	0.03	a)
X52596458591	4.2500 % BXBAU 4 1/4 03/22/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.81%	205'616.00	0.03	a)
X52596537972	3.5000 % ADNA 3 1/2 04/04/28	0	200	0	200 EUR	99.96%	199'912.38	0.03	a)
X52596599063	4.6990 % NWG 4.699 03/14/28 EMTN	0	150	0	150 EUR	102.04%	153'052.50	0.02	a)
X52596599147	4.5000 % PNDORA 4 1/2 04/10/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.40%	204'794.00	0.03	a)
X52597093009	4.0500 % TOYOTA 4.05 09/13/29 EMTN	0	350	0	350 EUR	102.53%	358'865.50	0.05	a)
X52597110027	4.3750 % STLA 4 3/8 03/14/30 EMTN	0	500	0	500 EUR	103.58%	517'900.00	0.07	a)
X52597113989	4.7520 % HSBC 4.752 03/10/28 EMTN	0	350	0	350 EUR	102.22%	357'763.00	0.05	a)
X52597114284	4.7870 % HSBC 4.787 03/10/32 EMTN	0	350	0	350 EUR	103.78%	363'244.00	0.05	a)
X52597677090	4.3750 % MGCN 4 3/8 03/17/32	0	150	0	150 EUR	103.86%	155'787.00	0.02	a)
X52597696124	4.0000 % DNBNO 4 03/14/29 EMTN	0	1'200	0	1'200 EUR	101.29%	1'215'420.00	0.17	a)
X52597973812	4.1250 % VWSDC 4 1/8 06/15/26 EMTN	0	250	0	250 EUR	100.50%	251'247.50	0.03	a)
X52597994065	4.8750 % GPN 4 7/8 03/17/31	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52597999452	4.7500 % BACRED 4 3/4 03/14/28 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52598331242	5.0000 % SABSM 5 06/07/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	104.24%	208'482.00	0.03	a)
X52598332133	4.2500 % ALV 4 1/4 03/15/28 EMTN	0	150	0	150 EUR	101.30%	151'950.00	0.02	a)
X52598649254	3.8750 % NESVFH 3 7/8 03/16/29 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2599156192	5.5000 % VARNO 5 1/2 05/04/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	105.01%	210'012.00	0.03	a)
XS2599169922	4.1250 % HEIANA 4 1/8 03/23/35 EMTN	0	250	0	250 EUR	104.30%	260'757.50	0.04	a)
XS2599730822	3.8750 % HEIANA 3 7/8 09/23/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.42%	204'842.00	0.03	a)
XS2599779597	4.2500 % NESVFH 4 1/4 03/16/33 EMTN	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2601458602	4.0000 % SIENFI 4 04/05/26	0	300	0	300 EUR	98.70%	296'103.00	0.04	a)
XS2601459162	4.2500 % SIENFI 4 1/4 04/05/29	0	300	0	300 EUR	98.13%	294'381.00	0.04	a)
XS2604697891	3.8750 % VW 3 7/8 03/29/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.00%	299'985.00	0.04	a)
XS2604699327	4.2500 % VW 4 1/4 03/29/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.20%	204'406.00	0.03	a)
XS2605914105	3.9070 % GIS 3.907 04/13/29	0	200	0	200 EUR	101.02%	202'042.00	0.03	a)
XS2606261597	4.5000 % FUMVFH 4 1/2 05/26/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.24%	206'478.00	0.03	a)
XS2606264005	4.0000 % FUMVFH 4 05/26/28 EMTN	0	150	0	150 EUR	100.67%	150'999.00	0.02	a)
XS2606297864	4.0000 % MET 4 04/05/28 EMTN	0	150	0	150 EUR	101.45%	152'179.50	0.02	a)
XS2607040958	4.2500 % NGTRAN 4 1/4 04/05/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.85%	203'702.00	0.03	a)
XS2607183980	5.1250 % HOG 5 1/8 04/05/26	0	250	0	250 EUR	102.20%	255'490.00	0.04	a)
XS2607193435	3.6250 % TRNIM 3 5/8 04/21/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.18%	200'360.00	0.03	a)
XS2607381436	4.2500 % SECUSS 4 1/4 04/04/27 EMTN	0	250	0	250 EUR	100.98%	252'455.00	0.03	a)
XS2609970848	5.3990 % ASSGEN 5.399 04/20/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	104.95%	209'902.00	0.03	a)
XS2610457967	5.5000 % AXASA 5 1/2 07/11/43 EMTN	0	300	0	300 EUR	105.60%	316'809.00	0.04	a)
XS2611221032	6.6250 % PTSB 6 5/8 04/25/28	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2613162424	3.7500 % TLSAU 3 3/4 05/04/31	0	200	0	200 EUR	101.37%	202'738.00	0.03	a)
XS2613209670	4.3750 % SYDAU 4 3/8 05/03/33 EMTN	0	350	0	350 EUR	103.11%	360'878.00	0.05	a)
XS2613472963	4.2500 % HERIM 4 1/4 04/20/33 EMTN	0	150	0	150 EUR	102.38%	153'565.50	0.02	a)
XS2613658041	4.2330 % RABOBK 4.233 04/25/29 GMTN	0	400	0	400 EUR	101.45%	405'792.00	0.06	a)
XS2613658710	4.3750 % ABNAV 4 3/8 10/20/28	0	400	0	400 EUR	102.36%	409'452.00	0.06	a)
XS2613666739	4.6360 % MUFUG 4.636 06/07/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.97%	207'934.00	0.03	a)
XS2615271629	5.0000 % JYBC 5 10/26/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.10%	204'206.00	0.03	a)
XS2616008541	3.7500 % SIKASW 3 3/4 11/03/26	0	400	0	400 EUR	100.60%	402'412.00	0.06	a)
XS2616008970	3.7500 % SIKASW 3 3/4 05/03/30	0	200	0	200 EUR	101.49%	202'986.00	0.03	a)
XS2616652637	6.0000 % NNGRNV 6 11/03/43 EMTN	0	350	0	350 EUR	105.47%	369'145.00	0.05	a)
XS2617256149	3.2500 % PG 3 1/4 08/02/31	0	200	0	200 EUR	100.48%	200'952.00	0.03	a)
XS2617442525	4.2500 % VW 4 1/4 01/07/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.41%	301'227.00	0.04	a)
XS2617456582	4.3750 % VW 4 3/8 05/03/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.39%	202'772.00	0.03	a)
XS2617457127	4.6250 % VW 4 5/8 05/03/31 EMTN	0	100	0	100 EUR	102.73%	102'729.00	0.01	a)
XS2618499177	3.7500 % SHBASS 3 3/4 05/05/26 EMTN	0	400	0	400 EUR	100.31%	401'224.00	0.06	a)
XS2618690981	4.1250 % SANSFC 4 1/8 05/05/28 EMTN	0	400	0	400 EUR	101.59%	406'376.00	0.06	a)
XS2618731256	4.8740 % STANLN 4.874 05/10/31	0	250	0	250 EUR	103.38%	258'437.50	0.04	a)
XS2618906585	4.1250 % NDAFH 4 1/8 05/05/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.49%	304'473.00	0.04	a)
XS2619751576	3.8750 % SEB 3 7/8 05/09/28 EMTN	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2620201421	4.1250 % BBVASM 4 1/8 05/10/26 GMTN	0	200	0	200 EUR	100.14%	200'276.00	0.03	a)
XS2620585906	4.3230 % BPLN 4.323 05/12/35 EMTN	0	250	0	250 EUR	104.17%	260'412.50	0.04	a)
XS2621007231	3.6250 % BKNG 3 5/8 11/12/28	0	200	0	200 EUR	100.25%	200'508.00	0.03	a)
XS2621007660	4.1250 % BKNG 4 1/8 05/12/33	0	350	0	350 EUR	103.02%	360'566.50	0.05	a)
XS2621757744	4.1250 % GLW 4 1/8 05/15/31	0	200	0	200 EUR	102.28%	204'554.00	0.03	a)
XS2621812192	3.3750 % PCAR 3 3/8 05/15/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.48%	198'956.00	0.03	a)
XS2622275969	4.6250 % AMT 4 5/8 05/16/31	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2623129256	3.8750 % DTRGR 3 7/8 06/19/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.67%	201'342.00	0.03	a)
XS2623221228	3.8750 % DTRGR 3 7/8 06/19/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.60%	203'208.00	0.03	a)
XS2623496085	6.1250 % F 6 1/8 05/15/28	0	200	0	200 EUR	106.92%	213'838.00	0.03	a)
XS2623501181	4.6250 % CABKSM 4 5/8 05/16/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.18%	303'525.00	0.04	a)
XS2623518821	4.7710 % NWG 4.771 02/16/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	102.74%	308'214.00	0.04	a)
XS2623668634	3.7420 % CAT 3.742 09/04/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.48%	301'428.00	0.04	a)
XS2623868994	3.7500 % TELBSS 3 3/4 11/22/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.06%	200'126.00	0.03	a)
XS2623956773	4.2500 % ENIIM 4 1/4 05/19/33 EMTN	0	400	0	400 EUR	102.25%	409'016.00	0.06	a)
XS2623957078	3.6250 % ENIIM 3 5/8 05/19/27 EMTN	0	500	0	500 EUR	99.95%	499'735.00	0.07	a)
XS2624976077	4.5000 % INTNED 4 1/2 05/23/29	0	500	0	500 EUR	102.00%	510'000.00	0.07	a)
XS2624977554	4.7500 % INTNED 4 3/4 05/23/34	0	500	0	500 EUR	105.32%	526'595.00	0.07	a)
XS2625136531	4.0000 % AKZANA 4 05/24/33 EMTN	0	150	0	150 EUR	101.91%	152'863.50	0.02	a)
XS2625194225	4.7500 % TVOYFH 4 3/4 06/01/30 EMTN	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2625195891	4.0000 % ISPIIM 4 05/19/26 EMTN	0	250	0	250 EUR	100.41%	251'017.50	0.03	a)
XS2625196352	4.8750 % ISPIIM 4 7/8 05/19/30 EMTN	0	350	0	350 EUR	104.82%	366'852.50	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2625968347	3.2500 % BMW 3 1/4 07/22/30 EMTN	0	150	0	150 EUR	100.25%	150'369.00	0.02	a)
XS2625968776	3.6250 % BMW 3 5/8 05/22/35 EMTN	0	250	0	250 EUR	100.94%	252'352.50	0.03	a)
XS2625985945	4.5000 % GM 4 1/2 11/22/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.09%	204'188.00	0.03	a)
XS2626007939	4.2500 % JCI 4 1/4 05/23/35	0	250	0	250 EUR	103.54%	258'847.50	0.04	a)
XS2626022573	4.1250 % WPPLN 4 1/8 05/30/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.28%	202'564.00	0.03	a)
XS2626289222	4.8750 % IILN 4 7/8 06/14/29	0	200	0	200 EUR	103.57%	207'142.00	0.03	a)
XS2626343375	3.6250 % VLVY 3 5/8 05/25/27 EMTN	0	150	0	150 EUR	100.11%	150'157.50	0.02	a)
XS2626691906	4.6250 % DEVOPA 4 5/8 11/23/27 EMTN	0	100	0	100 EUR	101.47%	101'470.00	0.01	a)
XS2626699982	5.7500 % SANTAN 5 3/4 08/23/33 EMTN	0	400	0	400 EUR	103.66%	414'628.00	0.06	a)
XS2628785466	4.1250 % DNFSDC 4 1/8 12/02/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.18%	204'368.00	0.03	a)
XS2628821873	4.1250 % LLOYDS 4 1/8 05/30/27 EMTN	0	250	0	250 EUR	101.03%	252'562.50	0.03	a)
XS2629064267	4.2500 % STERV 4 1/4 09/01/29 EMTN	0	150	0	150 EUR	101.34%	152'010.00	0.02	a)
XS2629468278	3.6250 % RBOSGR 3 5/8 06/02/30 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.89%	302'661.00	0.04	a)
XS2629470506	3.6250 % RBOSGR 3 5/8 06/02/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.44%	200'870.00	0.03	a)
XS2629470761	4.3750 % RBOSGR 4 3/8 06/02/43 EMTN	0	500	0	500 EUR	103.71%	518'565.00	0.07	a)
XS2629470845	4.0000 % RBOSGR 4 06/02/35 EMTN	0	400	0	400 EUR	102.09%	408'368.00	0.06	a)
XS2629485447	4.4920 % SUMIBK 4.492 06/12/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	104.01%	208'014.00	0.03	a)
XS2630111719	4.6250 % BAYNGR 4 5/8 05/26/33 EMTN	0	450	0	450 EUR	100.40%	451'818.00	0.06	a)
XS2630112014	4.2500 % BAYNGR 4 1/4 08/26/29 EMTN	0	250	0	250 EUR	100.57%	251'425.00	0.03	a)
XS2630117328	4.0000 % CONGR 4 06/01/28 EMTN	0	250	0	250 EUR	101.52%	253'802.50	0.03	a)
XS2630417124	6.1250 % CABKSM 6 1/8 05/30/34 EMTN	0	300	0	300 EUR	104.62%	313'866.00	0.04	a)
XS2630448434	6.3750 % NIBCAP 6 3/8 12/01/25 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.57%	207'130.00	0.03	a)
XS2630465875	4.6250 % WERFEN 4 5/8 06/06/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.14%	202'278.00	0.03	a)
XS2631822868	3.5000 % STATK 3 1/2 06/09/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.31%	200'624.00	0.03	a)
XS2631867533	3.7500 % RELN 3 3/4 06/12/31	0	200	0	200 EUR	101.14%	202'282.00	0.03	a)
XS2631869232	4.3750 % FIREIT 4 3/8 06/06/33 EMTN	0	150	0	150 EUR	100.61%	150'919.50	0.02	a)
XS2632654161	3.3000 % UNANA 3.3 06/06/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.16%	200'318.00	0.03	a)
XS2632655135	3.4000 % UNANA 3.4 06/06/33 EMTN	0	150	0	150 EUR	100.27%	150'406.50	0.02	a)
XS2633317701	4.1250 % IGIM 4 1/8 06/08/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.52%	203'048.00	0.03	a)
XS2634593938	3.3750 % LIN 3 3/8 06/12/29	0	200	0	200 EUR	100.34%	200'684.00	0.03	a)
XS2634594076	3.6250 % LIN 3 5/8 06/12/34	0	300	0	300 EUR	101.05%	303'135.00	0.04	a)
XS2634616572	3.6250 % ENEXIS 3 5/8 06/12/34 EMTN	0	150	0	150 EUR	102.28%	153'415.50	0.02	a)
XS2634690114	4.2500 % STLA 4 1/4 06/16/31 EMTN	0	300	0	300 EUR	102.06%	306'174.00	0.04	a)
XS2634826031	4.2500 % SANTAN 4 1/4 06/12/30 EMTN	0	400	0	400 EUR	102.80%	411'212.00	0.06	a)
XS2635428274	5.0000 % DNBNO 5 09/13/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.81%	203'614.00	0.03	a)
XS2635647154	3.2500 % ALLRNV 3 1/4 06/13/28 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2636592102	5.7500 % BBVASM 5 3/4 09/15/33 GMTN	0	200	0	200 EUR	104.23%	208'460.00	0.03	a)
XS2636745882	5.1250 % ATOSTR 5 1/8 06/14/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	104.27%	208'534.00	0.03	a)
XS2637421848	4.7500 % DANBNK 4 3/4 06/21/30 EMTN	0	300	0	300 EUR	103.41%	310'230.00	0.04	a)
XS2637963146	3.8750 % ABNAV 3 7/8 12/21/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.02%	303'045.00	0.04	a)
XS2637967139	5.5000 % ABNAV 5 1/2 09/21/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.36%	206'712.00	0.03	a)
XS2638080452	3.8750 % KPN 3 7/8 07/03/31 GMTN	0	200	0	200 EUR	101.24%	202'486.00	0.03	a)
XS2641164491	4.2500 % CDTFIN 4 1/4 07/05/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.15%	204'290.00	0.03	a)
XS2641927574	6.6250 % PTSB 6 5/8 06/30/29	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2643234011	5.0000 % BKIR 5 07/04/31 EMTN	0	250	0	250 EUR	105.28%	263'192.50	0.04	a)
XS2643673952	4.5000 % NDAQ 4 1/2 02/15/32	0	250	0	250 EUR	103.91%	259'780.00	0.04	a)
XS2644414125	5.2500 % TKAAY 5 1/4 07/13/28	0	200	0	200 EUR	104.27%	208'534.00	0.03	a)
XS2644423035	3.3750 % DHLGR 3 3/8 07/03/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.50%	199'000.00	0.03	a)
XS2644969425	4.8750 % O 4 7/8 07/06/30	0	150	0	150 EUR	105.19%	157'780.50	0.02	a)
XS2644969698	5.1250 % O 5 1/8 07/06/34	0	200	0	200 EUR	107.09%	214'188.00	0.03	a)
XS2648077191	4.0000 % CRHID 4 07/11/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.99%	203'986.00	0.03	a)
XS2648077274	4.2500 % CRHID 4 1/4 07/11/35 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.94%	205'888.00	0.03	a)
XS2648080229	4.5000 % HTHROW 4 1/2 07/11/33 EMTN	0	250	0	250 EUR	103.63%	259'062.50	0.04	a)
XS2648498371	3.6250 % IBESM 3 5/8 07/13/33 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.45%	301'350.00	0.04	a)
XS2649712689	5.0000 % CABKSM 5 07/19/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	103.74%	311'211.00	0.04	a)
XS2652069480	4.5000 % DNBNO 4 1/2 07/19/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.85%	305'550.00	0.04	a)
XS2652072864	5.1250 % CABKSM 5 1/8 07/19/34 EMTN	0	200	0	200 EUR	106.14%	212'272.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
X52654097927	4.3750 % SMDSLN 4 3/8 07/27/27 EMTN	0	250	0	250 EUR	101.63%	254'062.50	0.03	a)
X52654098222	4.5000 % SMDSLN 4 1/2 07/27/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.87%	205'732.00	0.03	a)
X52655852726	3.8750 % TRNIM 3 7/8 07/24/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.93%	201'856.00	0.03	a)
X52655865546	3.8500 % TOYOTA 3.85 07/24/30 EMTN	0	250	0	250 EUR	101.64%	254'090.00	0.03	a)
X52657613720	3.7500 % HNDLA 3 3/4 10/25/27	0	250	0	250 EUR	100.70%	251'737.50	0.03	a)
X52662538425	4.9180 % BACR 4.918 08/08/30 EMTN	0	400	0	400 EUR	103.06%	412'248.00	0.06	a)
X52667124569	5.0000 % SHBASS 5 08/16/34 EMTN	0	240	0	240 EUR	102.00%	244'788.00	0.03	a)
X52672418055	4.6080 % MIZUHO 4.608 08/28/30 EMTN	0	250	0	250 EUR	104.07%	260'182.50	0.04	a)
X52672452237	4.0000 % CONGR 4 03/01/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.93%	201'852.00	0.03	a)
X52673536541	3.7500 % EOANGR 3 3/4 03/01/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.46%	202'916.00	0.03	a)
X52673547746	4.0000 % EOANGR 4 08/29/33 EMTN	0	250	0	250 EUR	102.32%	255'802.50	0.04	a)
X52673808486	4.3750 % ISPIM 4 3/8 08/29/27 EMTN	0	250	0	250 EUR	101.88%	254'692.50	0.03	a)
X52673808726	5.1250 % ISPIM 5 1/8 08/29/31 EMTN	0	450	0	450 EUR	106.36%	478'633.50	0.07	a)
X52673969650	5.2500 % IDSLN 5 1/4 09/14/28	0	200	0	200 EUR	103.27%	206'544.00	0.03	a)
X52673972795	3.5000 % NDAFH 3 1/2 08/31/26 EMTN	0	400	0	400 EUR	100.52%	402'076.00	0.06	a)
X52675225531	4.2500 % BRITEL 4 1/4 01/06/33 EMTN	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52675685700	4.0000 % SSELN 4 09/05/31 EMTN	0	250	0	250 EUR	102.31%	255'767.50	0.04	a)
X52675722750	5.1250 % SYDBDC 5 1/8 09/06/28 GMTN	0	200	0	200 EUR	102.34%	204'672.00	0.03	a)
X52675884576	7.5000 % VW 7 1/2 PERP PNC5	0	300	0	300 EUR	107.22%	321'645.00	0.04	a)
X52675884733	7.8750 % VW 7 7/8 PERP	0	300	0	300 EUR	111.04%	333'132.00	0.05	a)
X52676305779	4.3750 % SWEDA 4 3/8 09/05/30 GMTN	0	150	0	150 EUR	102.10%	153'142.50	0.02	a)
X52676395077	4.3750 % SRTGR 4 3/8 09/14/29	0	200	0	200 EUR	102.46%	204'928.00	0.03	a)
X52676395317	4.5000 % SRTGR 4 1/2 09/14/32	0	300	0	300 EUR	102.98%	308'952.00	0.04	a)
X52676395408	4.8750 % SRTGR 4 7/8 09/14/35	0	300	0	300 EUR	105.17%	315'501.00	0.04	a)
X52676413235	5.7370 % CESSPO 5.737 03/08/28 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52676814499	4.2500 % CABKSM 4 1/4 09/06/30 EMTN	0	400	0	400 EUR	102.75%	410'984.00	0.06	a)
X52676816940	4.3750 % NDAFH 4 3/8 09/06/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.67%	302'004.00	0.04	a)
X52676818482	4.3750 % SECUSS 4 3/8 03/06/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.24%	204'484.00	0.03	a)
X52676863355	4.2500 % PHIANA 4 1/4 09/08/31 EMTN	0	150	0	150 EUR	100.26%	150'393.00	0.02	a)
X52676883114	4.7500 % ERFFP 4 3/4 09/06/30	0	200	0	200 EUR	101.87%	203'748.00	0.03	a)
X52677668357	4.8750 % IMCDNA 4 7/8 09/18/28	0	150	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52678111050	4.2500 % SRTGR 4 1/4 09/14/26	0	200	0	200 EUR	100.78%	201'568.00	0.03	a)
X52678191904	4.1250 % ASSABS 4 1/8 09/13/35 GMTN	0	200	0	200 EUR	105.03%	210'064.00	0.03	a)
X52678207676	3.7500 % ASSABS 3 3/4 09/13/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.63%	201'250.00	0.03	a)
X52678226114	3.8750 % ASSABS 3 7/8 09/13/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.51%	205'018.00	0.03	a)
X52678749990	5.2720 % ASSGEN 5.272 09/12/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.80%	207'596.00	0.03	a)
X52679878319	4.3750 % SCBGER 4 3/8 09/13/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.18%	202'362.00	0.03	a)
X52679898184	4.8750 % REWEEG 4 7/8 09/13/30	0	300	0	300 EUR	104.10%	312'288.00	0.04	a)
X52679903950	4.1250 % LSELN 4 1/8 09/29/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.25%	303'756.00	0.04	a)
X52679904685	4.2310 % LSELN 4.231 09/29/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.38%	206'764.00	0.03	a)
X52680745382	4.6680 % NGGLN 4.668 09/12/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	104.80%	209'608.00	0.03	a)
X52680945479	4.3750 % FERSM 4 3/8 09/13/30	0	200	0	200 EUR	103.10%	206'202.00	0.03	a)
X52681383662	3.6250 % RKTLLN 3 5/8 09/14/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.75%	201'506.00	0.03	a)
X52681384041	3.8750 % RKTLLN 3 7/8 09/14/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.08%	204'164.00	0.03	a)
X52682093526	6.0000 % RBAIV 6 09/15/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	104.73%	209'458.00	0.03	a)
X52682331728	4.8750 % BACRED 4 7/8 09/13/27 EMTN	0	200	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
X52689127467	4.1500 % VLTO 4.15 09/19/31 REGS	0	200	0	200 EUR	101.24%	202'474.00	0.03	a)
X52690050682	5.0000 % BUPFIN 5 10/12/30	0	200	0	200 EUR	104.72%	209'438.00	0.03	a)
X52690137299	4.7500 % LLOYDS 4 3/4 09/21/31 EMTN	0	400	0	400 EUR	103.33%	413'328.00	0.06	a)
X52694872081	4.5000 % VW 4 1/2 03/25/26 EMTN	0	250	0	250 EUR	101.44%	253'595.00	0.03	a)
X52694872594	4.6250 % VW 4 5/8 03/25/29 EMTN	0	160	0	160 EUR	103.80%	166'080.00	0.02	a)
X52694874533	4.7500 % VW 4 3/4 09/25/31 EMTN	0	250	0	250 EUR	104.81%	262'025.00	0.04	a)
X52694995163	3.6250 % ASARNED 3 5/8 12/12/28	0	200	0	200 EUR	99.36%	198'726.00	0.03	a)
X52695009998	7.8750 % GLJGR 7 7/8 04/06/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	107.62%	215'246.00	0.03	a)
X52696046460	4.0000 % CARLB 4 10/05/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.01%	204'024.00	0.03	a)
X52696089197	4.2500 % CARLB 4 1/4 10/05/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	104.87%	209'740.00	0.03	a)
X52696749626	4.0000 % TOYOTA 4 04/02/27 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.39%	202'770.00	0.03	a)
X52696780464	4.3750 % RY 4 3/8 10/02/30 EMTN	0	300	0	300 EUR	103.30%	309'906.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2696803696	4.0000 % TELNO 4 10/03/30 EMTN	0	150	0	150 EUR	103.05%	154'567.50	0.02	a)
XS2696803852	4.2500 % TELNO 4 1/4 10/03/35 EMTN	0	200	0	200 EUR	105.66%	211'326.00	0.03	a)
XS2696903728	4.5000 % ISPIM 4 1/2 10/02/25 EMTN	0	150	0	150 EUR	100.79%	151'179.00	0.02	a)
XS2697483118	4.1250 % INTNED 4 1/8 10/02/26 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.24%	303'729.00	0.04	a)
XS2697970536	4.2500 % ESBIRE 4 1/4 03/03/36 EMTN	0	200	0	200 EUR	104.33%	208'662.00	0.03	a)
XS2697983869	4.0000 % ESBIRE 4 10/03/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.46%	202'914.00	0.03	a)
XS2698148702	4.6250 % DNBNO 4 5/8 11/01/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	102.88%	308'646.00	0.04	a)
XS2698713695	5.1250 % FREGR 5 1/8 10/05/30 EMTN	0	150	0	150 EUR	106.05%	159'078.00	0.02	a)
XS2698773830	3.8750 % BMW 3 7/8 10/04/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.32%	204'640.00	0.03	a)
XS2698773913	4.1250 % BMW 4 1/8 10/04/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	104.99%	209'972.00	0.03	a)
XS2699159278	4.1250 % EDPL 4 1/8 04/04/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.40%	204'802.00	0.03	a)
XS2699159351	4.3750 % EDPL 4 3/8 04/04/32 EMTN	0	250	0	250 EUR	104.37%	260'930.00	0.04	a)
XS2704918478	4.8750 % HMBSS 4 7/8 10/25/31 EMTN	0	150	0	150 EUR	104.46%	156'687.00	0.02	a)
XS2705604077	4.6250 % SANTAN 4 5/8 10/18/27 EMTN	0	400	0	400 EUR	101.16%	404'640.00	0.06	a)
XS2705604234	4.8750 % SANTAN 4 7/8 10/18/31 EMTN	0	600	0	600 EUR	104.73%	628'350.00	0.09	a)
XS2707169111	5.2500 % AIB 5 1/4 10/23/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	105.94%	211'870.00	0.03	a)
XS2710354544	4.5000 % NWDIE 4 1/2 11/01/26 EMTN	0	400	0	400 EUR	102.06%	408'240.00	0.06	a)
XS2712746960	3.9130 % RABOBK 3.913 11/03/26 GMTN	0	400	0	400 EUR	100.97%	403'884.00	0.06	a)
XS2715276163	3.8750 % SHBASS 3 7/8 05/10/27 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.98%	302'943.00	0.04	a)
XS2715297672	3.9700 % SDZSW 3.97 04/17/27	0	300	0	300 EUR	100.91%	302'721.00	0.04	a)
XS2715302001	4.1250 % GIVNVX 4 1/8 11/28/33	0	200	0	200 EUR	103.38%	206'754.00	0.03	a)
XS2715918020	4.5000 % DANBNK 4 1/2 11/09/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.65%	203'296.00	0.03	a)
XS2715940891	4.2200 % SDZSW 4.22 04/17/30	0	300	0	300 EUR	101.99%	305'961.00	0.04	a)
XS2715941949	4.5000 % SDZSW 4 1/2 11/17/33	0	200	0	200 EUR	103.46%	206'914.00	0.03	a)
XS2715957358	4.8750 % JYBC 4 7/8 11/10/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.04%	204'070.00	0.03	a)
XS2716891440	6.6510 % EPEN 6.651 11/13/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.99%	203'982.00	0.03	a)
XS2717291970	4.4570 % JPM 4.457 11/13/31 EMTN	0	675	0	675 EUR	103.49%	698'564.25	0.10	a)
XS2717300391	4.1250 % SWEDA 4 1/8 11/13/28 GMTN	0	300	0	300 EUR	102.24%	306'726.00	0.04	a)
XS2717301365	4.6250 % BKIR 4 5/8 11/13/29 EMTN	0	300	0	300 EUR	102.47%	307'410.00	0.04	a)
XS2717309855	3.5000 % NESNVX 3 1/2 01/17/30 EMTN	0	150	0	150 EUR	101.48%	152'214.00	0.02	a)
XS2717310945	3.7500 % NESNVX 3 3/4 11/14/35	0	150	0	150 EUR	102.97%	154'452.00	0.02	a)
XS2719096831	3.6250 % HEIANA 3 5/8 11/15/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.27%	200'536.00	0.03	a)
XS2720095541	5.3500 % TPR 5.35 11/27/25	0	200	0	200 EUR	101.50%	203'002.00	0.03	a)
XS2720095624	5.3750 % TPR 5 3/8 11/27/27	0	150	0	150 EUR	103.10%	154'654.50	0.02	a)
XS2720095970	5.8750 % TPR 5 7/8 11/27/31	0	150	0	150 EUR	105.53%	158'295.00	0.02	a)
XS2722162315	4.1830 % TELEFO 4.183 11/21/33 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.75%	305'262.00	0.04	a)
XS2722717472	3.8500 % ENBW 3.85 05/23/30 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.29%	202'582.00	0.03	a)
XS2722717555	4.3000 % ENBW 4.3 05/23/34 EMTN	0	300	0	300 EUR	103.02%	309'063.00	0.04	a)
XS2723549361	3.8750 % SGOPF 3 7/8 11/29/30 EMTN	0	300	0	300 EUR	101.45%	304'359.00	0.04	a)
XS2723549528	3.7500 % SGOPF 3 3/4 11/29/26 EMTN	0	200	0	200 EUR	100.30%	200'600.00	0.03	a)
XS2723565672	4.7471 % MQGAU 4.7471 01/23/30 EMTN	0	150	0	150 EUR	104.43%	156'649.50	0.02	a)
XS2723575879	4.1250 % CARR 4 1/8 05/29/28 REGS	0	250	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2723577149	4.5000 % CARR 4 1/2 11/29/32 REGS	0	300	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
XS2723593187	4.3750 % IHGLN 4 3/8 11/28/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	102.02%	204'034.00	0.03	a)
XS2723597923	3.1250 % STATK 3 1/8 12/13/26 EMTN	0	100	0	100 EUR	99.15%	99'152.00	0.01	a)
XS2723860990	4.8750 % NDAFH 4 7/8 02/23/34 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.65%	203'290.00	0.03	a)
XS2724457457	5.1250 % F 5 1/8 02/20/29 EMTN	0	250	0	250 EUR	103.51%	258'780.00	0.04	a)
XS2725836410	5.3750 % ERICB 5 3/8 05/29/28 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.53%	207'054.00	0.03	a)
XS2725957042	4.1250 % VWSDC 4 1/8 06/15/31 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.63%	203'266.00	0.03	a)
XS2725959683	4.0000 % SRGIM 4 11/27/29 EMTN	0	200	0	200 EUR	101.49%	202'974.00	0.03	a)
XS2726256113	4.3750 % CABKSM 4 3/8 11/29/33 EMTN	0	200	0	200 EUR	103.73%	207'456.00	0.03	a)
XS2726262863	3.6250 % MCD 3 5/8 11/28/27 GMTN	0	100	0	100 EUR	100.22%	100'223.00	0.01	a)
XS2726263325	3.8750 % MCD 3 7/8 02/20/31 GMTN	0	200	0	200 EUR	101.44%	202'882.00	0.03	a)
XS2726263911	4.1250 % MCD 4 1/8 11/28/35 GMTN	0	300	0	300 EUR	101.61%	304'830.00	0.04	a)
XS2726331932	3.3120 % ROSW 3.312 12/04/27	0	150	0	150 EUR	100.21%	150'321.00	0.02	a)
XS2726335099	3.5860 % ROSW 3.586 12/04/36	0	250	0	250 EUR	101.82%	254'550.00	0.03	a)
XS2726461986	3.8750 % CCEP 3 7/8 12/01/30	0	150	0	150 EUR	101.54%	152'314.50	0.02	a)
XS2728560959	4.5000 % JDEPNA 4 1/2 01/23/34 EMTN	0	150	0	150 EUR	102.23%	153'340.50	0.02	a)
XS2728561098	4.1250 % JDEPNA 4 1/8 01/23/30 EMTN	0	100	0	100 EUR	100.45%	100'452.00	0.01	a)
XS2731506841	3.7500 % MET 3 3/4 12/07/31 GMTN	0	100	0	100 EUR	100.92%	100'922.00	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
XS2732952838	3.3750 % SYK 3 3/8 12/11/28	0	100	0	100 EUR	99.36%	99'355.00	0.01	a)
XS2739054489	4.5060 % BACR 4.506 01/31/33	0	250	0	250 EUR	100.14%	250'342.50	0.03	a)
XS2739132897	3.8750 % ENIIM 3 7/8 01/15/34 EMTN	0	400	0	400 EUR	98.84%	395'352.00	0.05	a)
XS2741808898	3.8750 % DANBNK 3 7/8 01/09/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	98.31%	196'620.00	0.03	a)
XS2742660157	3.6250 % MOTOPG 3 5/8 07/24/29 EMTN	0	150	0	150 EUR	100.35%	150'525.00	0.02	a)
XS2742660660	3.8750 % MOTOPG 3 7/8 01/24/34 EMTN	0	350	0	350 EUR	100.28%	350'994.00	0.05	a)
XS2743029253	3.5000 % SANTAN 3 1/2 01/09/28 EMTN	0	300	0	300 EUR	98.85%	296'541.00	0.04	a)
XS2743029766	3.5000 % SANTAN 3 1/2 01/09/30 EMTN	0	300	0	300 EUR	98.25%	294'744.00	0.04	a)
XS2743029840	3.7500 % SANTAN 3 3/4 01/09/34 EMTN	0	400	0	400 EUR	98.74%	394'948.00	0.05	a)
XS2743047156	4.3750 % LLOYDS 4 3/8 04/05/34 EMTN	0	150	0	150 EUR	98.01%	147'012.00	0.02	a)
XS2744121869	3.1250 % TOYOTA 3 1/8 01/11/27 EMTN	0	250	0	250 EUR	98.77%	246'925.00	0.03	a)
XS2744299335	3.0000 % REESM 3 01/17/34 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.06%	194'120.00	0.03	a)
XS2745115837	3.6250 % NWG 3 5/8 01/09/29 EMTN	0	232	0	232 EUR	99.35%	230'498.96	0.03	a)
XS2747065030	3.8750 % BBVASM 3 7/8 01/15/34 EMTN	0	300	0	300 EUR	100.23%	300'693.00	0.04	a)
XS2747181969	3.1250 % ABBNVX 3 1/8 01/15/29 EMTN	0	150	0	150 EUR	99.05%	148'579.50	0.02	a)
XS2747182181	3.3750 % ABBNVX 3 3/8 01/15/34 EMTN	0	300	0	300 EUR	98.10%	294'312.00	0.04	a)
XS2747596315	3.5470 % ASSGEN 3.547 01/15/34 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.58%	195'152.00	0.03	a)
XS2747600109	3.7500 % EOANGR 3 3/4 01/15/36	0	300	0	300 EUR	98.85%	296'550.00	0.04	a)
XS2747610751	3.8750 % ABNAV 3 7/8 01/15/32 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.06%	198'120.00	0.03	a)
XS2751598322	3.6250 % ENGSM 3 5/8 01/24/34 EMTN	0	200	0	200 EUR	97.52%	195'038.00	0.03	a)
XS2751666699	3.8750 % ENELIM 3 7/8 01/23/35 EMTN	0	350	0	350 EUR	98.54%	344'890.00	0.05	a)
XS2751667150	5.0000 % SANTAN 5 04/22/34 EMTN	0	400	0	400 EUR	100.22%	400'860.00	0.06	a)
XS2751678272	5.2500 % ENBW 5 1/4 01/23/2084	0	200	0	200 EUR	100.92%	201'830.00	0.03	a)
XS2751688826	4.1250 % CARR 4 1/8 05/29/28	0	250	0	250 EUR	101.57%	253'925.00	0.03	a)
XS2751689048	4.5000 % CARR 4 1/2 11/29/32	0	300	0	300 EUR	104.73%	314'193.00	0.04	a)
XS2753311393	4.0550 % TELEFO 4.055 01/24/36 EMTN	0	200	0	200 EUR	99.75%	199'490.00	0.03	a)
XS2753315626	3.8220 % RABOBK 3.822 07/26/34 GMTN	0	100	0	100 EUR	99.89%	99'889.00	0.01	a)

EUR

717'478'007.27 98.48

Derivative Finanzinstrumente

0.00 0.00

Devisentermingeschäfte

CHF/EUR	Verfall 10.05.2023	1'343'455	1'320'000	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 27.12.2023	175'000	185'255	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 28.12.2023	1'008'822	950'000	EUR/CHF	0.00	0.00

Devisentermingeschäfte

0.00 0.00

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

EUR/CHF	Verfall 04.04.2023	22'693'540	22'868'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 04.04.2023	43'041	43'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 04.04.2023	22'911'000	22'741'000	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.05.2023	22'672'823	22'877'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.05.2023	195'506	197'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 03.05.2023	522'000	513'630	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 03.05.2023	22'552'000	22'158'919	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 02.06.2023	22'299'212	22'734'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 02.06.2023	176'495	180'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 02.06.2023	22'914'000	22'329'006	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 04.07.2023	22'425'926	23'056'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 04.07.2023	37'970	39'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 04.07.2023	129'000	126'337	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 04.07.2023	22'966'000	22'419'088	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.08.2023	22'133'870	22'710'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.08.2023	90'775	93'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 03.08.2023	22'803'000	21'792'827	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 04.09.2023	22'215'982	23'290'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 04.09.2023	183'781	192'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 04.09.2023	23'482'000	22'512'358	EUR/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.10.2023	22'285'284	23'286'000	CHF/EUR	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.10.2023	102'068	107'000	CHF/EUR	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
	CHF/EUR Verfall 03.10.2023		23'393'000	22'658'460		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		22'007'778	22'766'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		141'561	147'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		22'913'000	22'040'015		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		22'166'232	23'093'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		32'552	34'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		23'127'000	21'940'585		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		22'456'505	23'721'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		192'450	204'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2024		210'000	197'663		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2024		23'715'000	22'046'650		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		23'111'834	24'908'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		178'000	165'204		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		24'730'000	23'044'651		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		22'753'038	24'467'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		213'243	229'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.03.2024		24'696'000	23'534'053		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		22'640'814	23'807'000		CHF/EUR	0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							0.00	0.00	

Vermögensaufstellung	Kurswert EUR	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	2'886'108.65	0.40
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	717'478'007.27	98.48
Sonstige Vermögenswerte	8'159'983.23	1.12
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	728'524'099.15	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-1'084.63	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	728'523'014.52	

Bewertungskategorien	Kurswert EUR	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	717'478'007.27	98.48
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

CHF	1 = EUR	1.04944637
-----	---------	------------

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	EUR	23'760'320.18	3.261
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	EUR	-	-

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
FA EUR	EUR	0.00 - 0.60	-	0.463	0.00 - 0.10	-	0.008
NT EUR	EUR	0.00 - 0.60	-	0.463	0.00 - 0.10	-	0.008
NTH1 CHF	EUR	0.00 - 0.60	-	0.463	0.00 - 0.10	-	0.008

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

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	EUR	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

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

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

8 Benchmark

FTSE World Broad Investment-Grade Euro Corporate Bond Index TR

9 TER

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

10 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 18.06.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 21.06.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
FA EUR	Ja	EUR	1.50000	0.52500	0.97500

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 18.06.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 21.06.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
NT EUR	Ja	EUR	2.278	0.797	1.481
NTH1 CHF	Ja	EUR	1.769	0.619	1.150

12 Fussnoten

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

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

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

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

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund V

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

mit den Teilvermögen

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

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigen, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zwei Teilvermögen des Umbrella-Fonds miteinander zu vereinigen und den Fondsvertrag gemäss den nachfolgenden Ausführungen zu ändern.

In Teil 1 dieser Veröffentlichung finden sich die Ausführungen zu der Vereinigung und zu den in Zusammenhang mit der Vereinigung erforderlichen Fondsvertragsänderungen.

In Teil 2 dieser Veröffentlichung werden zusätzlichen Fondsvertragsänderungen, welche keinen Zusammenhang mit der geplanten Vereinigung aufweisen, erläutert. Dabei sollen folgende Anpassungen vorgenommen werden:

- Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. soll künftig als Zielfonds von einer anderen kollektiven Kapitalanlage der Swisscanto Fondsleitung AG dienen (vgl. Teil 2, Ziff. 1 dieser Veröffentlichung)
- Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF soll in diesem Zusammenhang daher ebenfalls repositioniert werden (vgl. Teil 2, Ziff. 2 dieser Veröffentlichung)
- Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF soll umbenannt und der Referenzindex soll gleichzeitig angepasst werden (vgl. Teil 2, Ziff. 3 dieser Veröffentlichung)
- Vereinigungen von Anteilsklassen und Löschung von bestehenden Anteilsklassen beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (siehe dazu die Ausführungen unter Teil 2, Ziff. 4 dieser Veröffentlichung).

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil 1 – Vereinigung von Teilvermögen

I Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzung der Vereinigung

1 Geplante Vereinigung

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, mit Zustimmung der Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigt, unter Vorbehalt der Genehmigung der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, die folgende Vereinigung des übertragenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds mit dem übernehmenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds durchzuführen:

Übertragendes Teilvermögen	Übernehmendes Teilvermögen	Stichtag der Vereinigung (Wirkung per – Datum)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	25. Juli 2023

2 Begründung für die Vereinigung

Mit der Vereinigung soll eine Konsolidierung der Produktpalette erreicht werden, welche die Transparenz erhöht und im Interesse der Anlegerinnen und Anleger ist. Die Vereinigung erlaubt das Eliminieren von Doppelspurigkeiten und ermöglicht ein kosteneffizienteres Fondsmanagement.

3 Voraussetzungen für die Vereinigung

Die Voraussetzungen für die Vereinigung sind in Art. 114 Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) sowie in § 25 des Fondsvertrages geregelt. Sämtliche Voraussetzungen für die Zulässigkeit der geplanten Vereinigung sind erfüllt:

- Die Möglichkeit der Vereinigung ist in § 25 des Fondsvertrages des Umbrella-Fonds vorgesehen.
- Die zu vereinigenden Teilvermögen werden von der gleichen Fondsleitung, der Swisscanto Fondsleitung AG, verwaltet.
- Der Fondsvertrag der zu vereinigenden Teilvermögen stimmt nach der Durchführung der in Bst. II. dieser Veröffentlichung beantragten Änderungen des Fondsvertrages der zu vereinigenden Teilvermögen hinsichtlich folgender Bestimmungen grundsätzlich überein:
 - a) Die Anlagepolitik, die Anlagetechniken und die Risikoverteilungsvorschriften sowie die mit der Anlage verbundenen Risiken;
 - b) Die Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten;
 - c) Die Art, die Höhe und die Berechnung aller Vergütungen, die Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie die Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen (Courtage, Gebühren, Abgaben), die dem Vermögen der Teilvermögen oder den Anlegern belastet werden dürfen;
 - d) Die Rücknahmebedingungen;
 - e) Die Laufzeit des Fondsvertrages und die Voraussetzungen der Auflösung.
- Die Vermögen der zu vereinigenden Teilvermögen werden auf den gleichen Tag bewertet, das Umtauschverhältnis berechnet und die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten übernommen.
- Weder den zu vereinigenden Teilvermögen noch den Anlegern erwachsen aus der Vereinigung Kosten.

4 Vereinigungsverfahren

Nach Inkrafttreten der in Bst. II dieser Veröffentlichung erläuterten Änderungen des Fondsvertrages wird mit Wirkung per 25. Juli 2023 das übertragende Teilvermögen mit dem übernehmenden Teilvermögen vereinigt. Die Vereinigung erfolgt durch Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des übertragenden Teilvermögens auf das übernehmende Teilvermögen. Auf den Zeitpunkt der Vereinigung wird das übertragende Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst.

Die Anlegerinnen und Anleger der nachfolgend aufgeführten Anteilklassen des übertragenden Teilvermögens erhalten nach der Berechnung des Umtauschverhältnisses Anteile der nachfolgend aufgeführten Anteilklassen des übernehmenden Teilvermögens. Die Anteilklassen des übertragenden Teilvermögens entsprechen dabei jeweils vollumfänglich der Anteilklasse des übernehmenden Teilvermögens, in welche sie im Rahmen der Vereinigung überführt werden.

Im Rahmen der Vereinigung werden die Anteile der Klassen FA CHF, GT CHF und NT CHF des übertragenden Teilvermögens in Anteile der neu zu eröffnenden Klassen FA CHF, GT CHF und NT CHF des übernehmenden Teilvermögens bei der Vereinigung per 25. Juli 2023 umgetauscht. Zudem werden per 25. Juli 2023 Anteile der Klasse DT CHF des übertragenden Teilvermögens mit den Anteilen der Klasse FA CHF des übernehmenden Teilvermögens vereinigt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Massnahme	Datum des Umtausches oder der Vereinigung
(übertragendes Teilvermögen)	(übernehmendes Teilvermögen)		
FA CHF	FA CHF	Umtausch	25. Juli 2023
DT CHF	FA CHF	Vereinigung	25. Juli 2023
GT CHF	GT CHF	Umtausch	25. Juli 2023
NT CHF	NT CHF	Umtausch	25. Juli 2023

Am Mittwoch, 26. Juli 2023, wird die Bewertung der Anlagen des übernehmenden bzw. übertragenden Teilvermögens aufgrund der Schlusskurse per Dienstag, 25. Juli 2023, durchgeführt. Am Mittwoch, 26. Juli 2023 (Bewertungstag), erfolgt die Vereinigung durch die Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des übertragenden Teilvermögens auf das übernehmende Teilvermögen rückwirkend auf Dienstag, 25. Juli 2023 (Vereinigungstichtag).

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG, Zürich, hat mit Schreiben vom 22. März 2023 zuhanden der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA bestätigt, dass nach ihrer Auffassung die gesetzlichen und fondsvertraglichen Voraussetzungen für die geplante Vereinigung erfüllt sind.

6 Vollzug der Vereinigung

Die Prüfgesellschaft wird den Vollzug der Vereinigung überwachen und prüfen. Nach erfolgter Durchführung und abgeschlossener Prüfung der Vereinigung durch die Prüfgesellschaft wird die Fondsleitung den Vollzug der Vereinigung mit Bekanntgabe der Umtauschverhältnisse sowie der Bericht der Prüfgesellschaft betreffend die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigung auf www.fundinfo.com veröffentlichen.

7 Kosten

Dem übertragenden Teilvermögen und den Anlegerinnen und Anlegern erwachsen aus der Vereinigung keine Kosten. Sämtliche Kosten werden von der Fondsleitung getragen.

8 Aufschiebung der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) (übertragendes Teilvermögen)	Letzter Cut Off (bis 14.00 Uhr)	20. Juli 2023
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen)	Letzter Cut Off (bis 14.00 Uhr)	20. Juli 2023
	Geschlossen (kein Cut Off von/bis)	21. Juli 2023 bis 26. Juli 2023

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigung der Teilvermögen

Der Umtausch der Anteile anlässlich der Vereinigung führt zu keinen Emissions- oder Umsatzabgabefolgen. Die Vereinigung löst auf Ebene der an der Vereinigung beteiligten Teilvermögen weder Ertrags- noch Gewinnsteuern aus.

II Änderungen im Fondsvertrag

Im Hinblick auf die Vereinigung erfolgt in der Anlagepolitik eine Angleichung der teilvermögensspezifischen Bestimmungen des übertragenden Teilvermögens an die entsprechenden Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens.

In § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrags wird neu ausgeführt, dass das übertragende Teilvermögen grundsätzlich den Referenzindex FTSE Non-CHF World Government Bond Index, Currency-Hedged in CHF nach bildet. Bis anhin war der FTSE Non-CHF World Government Bond Index der massgebende Referenzindex.

Teil 2 – Repositionierungen bei Teilvermögen, Umbenennung der Bezeichnung bei einem Teilvermögen und Vereinigung von Anteilsklassen und Löschung von bestehenden Anteilsklassen

1 Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. als Zielfonds

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. soll neu als Zielfonds für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) hedged CHF (neu beantragte Bezeichnung Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I), vgl. nachstehende Ziff. 3 dieser Veröffentlichung) dienen. Diesbezüglich werden in § 8 Ziff. 21, § 15 Ziff. 13 und 22 sowie § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages verschiedene Hinweise aufgenommen.

Vor diesem Hintergrund wird in § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) hedged CHF neu vorgesehen, dass die Fondsleitung für das Vermögen des Teilvermögens bis zu 100% der Anteile des Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. erwerben darf.

Die oben aufgeführte investierende kollektive Kapitalanlage, für welche das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. als Zielfonds fungiert, soll gemäss ihren Risikoverteilungsvorschriften jeweils bis zu 100% der Anteile des Zielfonds erwerben können (vgl. dazu die erwähnte Anpassung von § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages).

Erfolgt ein Antrag auf Rückgabe eines im Verhältnis zum Vermögen des Zielfonds grossen Teils der Anteile durch die massgebliche investierende kollektive Kapitalanlage, ist die Fondsleitung verpflichtet zu prüfen, ob diese Rückgabe ohne jeglichen Nachteil für die verbleibenden Anlegerinnen und Anleger abgewickelt werden kann. Erst dann lässt sie die betreffende Rückgabe zu. Ist die Rückgabe ohne Nachteile nicht gewährleistet, wird diese nicht zugelassen. Die Rücknahme durch den Zielfonds wird unverzüglich eingestellt und der betroffene Zielfonds wird fristlos aufgelöst. Die Rückzahlung wird dann im Rahmen des Auflösungsverfahrens vorgenommen. Ein entsprechender Hinweis wird in § 15 Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages aufgenommen.

2 Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF als investierende kollektive Kapitalanlage

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF soll neu in den Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. investieren können. In diesem Zusammenhang wird neu ausgeführt, dass das Teilvermögen höchstens 40% des Vermögens in Anteile bzw. Aktien des Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. investieren darf (vgl. die Anpassungen in § 8 Ziff. 21 sowie § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages).

Betreffend die weiteren für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF aufgenommenen Anpassungen in § 15 Ziff. 13, § 15 Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1, welche zum Ziel haben, dass das Teilvermögen in den Zielfonds investieren kann, wird auf die obenstehenden Ausführungen in Ziff. 1 dieser Veröffentlichung verwiesen.

In § 15 Ziff. 12 des Fondsvertrages wird zudem eine neue Bestimmung aufgenommen, wonach die Fondsleitung für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF höchstens 40% des Vermögens in Anteile bzw. Aktien desselben Zielfonds angelegt werden darf.

3 Umbenennung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF sowie entsprechende Anpassung in der Anlagepolitik

Die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens wird wie folgt geändert:

Aktuelle Bezeichnung	Neue Bezeichnung
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)

Im gesamten Fondsvertrag wird die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens angepasst (vgl. die Anpassungen in § 1 Ziff. 1, § 8 Ziff. 23 und 27 (nach Vereinigung neue Ziff. 26), § 15 Ziff. 3, 13 und 22, § 21 Ziff. 1 sowie § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages)

Gleichzeitig mit der Anpassung der Bezeichnung des Teilvermögens wird auch der Referenzindex entsprechend in § 8 Ziff. 26 des angepassten Fondsvertrages angepasst. Der bisherige Referenzindex ist der FTSE Non-CHF World Government Bond Index, Currency-Hedged in CHF. Der neue Referenzindex ist der FTSE Non-CHF World Government Bond Index.

4 Vereinigung von Anteilsklassen und Löschung von bestehenden Anteilsklassen

4.1 Vereinigung von Anteilsklassen

Per 25. Juli 2023 werden Anteile der Klasse DT CHF des übertragenden Teilvermögens mit den Anteilen der Klasse FA CHF des übernehmenden Teilvermögens vereinigt (vgl. unsere Ausführungen in Teil 1, I, Ziff. 4 dieser Veröffentlichung).

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Datum der Vereinigung
(übertragendes Teilvermögen)	(übernehmendes Teilvermögen)	
DT CHF	FA CHF	25. Juli 2023

Im Nachgang zur Vereinigung der Teilvermögen werden per 10. August 2023 die Anteile der Klasse DTH1 CHF des übernehmenden Teilvermögens mit den Anteilen der Klasse FAH1 CHF des übernehmenden Teilvermögens vereinigt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Datum der Vereinigung
FAH1 CHF	DTH1 CHF	10. August 2023

Die jeweilige übertragende Anteilsklasse des jeweiligen Teilvermögens wird gemäss der vorstehenden Tabelle, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, mit der jeweiligen übernehmenden Anteilsklasse des jeweiligen Teilvermögens vereinigt. Das Umtauschverhältnis für den Umtausch von Anteilen der jeweiligen übertragenden Anteilsklasse in Anteile der jeweiligen übernehmenden Anteilsklasse wird jeweils nach Durchführung der Vereinigung im Publikationsorgan des Umbrella-Fonds (www.fundinfo.com) veröffentlicht.

4.2 Löschung von bestehenden Anteilsklassen

Für das nachgenannte Teilvermögen sind die folgenden Anteilsklassen im angepassten Fondsvertrag nicht mehr vorgesehen (vgl. die Anpassungen in § 6 Ziff. 4 des Fondsvertrages):

Teilvermögen	Anteilsklassen
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	DT, DT CHF, DT EUR, DT GBP, DT USD, DTH1 EUR, DTH1 GBP, DTH1 USD

* * *

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

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

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

Zürich, 24. Mai 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des **Swisscanto (CH) Index Fund V**

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

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA
Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada
Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH
Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Domestic CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Foreign CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB 1-5 CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund USA Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World ex EUR/USD
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect
Swisscanto (CH) Index Commodity Fund

betreffend

Einstellung von Zeichnungen und Aufschub von Rückzahlungen von Anteilen des folgenden Teilvermögens des oben genannten Umbrella-Fonds

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

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) investiert einen wesentlichen Anteil seines Fondsvermögens in neun Teilvermögen (Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.) des Umbrella-Fonds *Swisscanto (CH) Index Fund II*, bei welchen im Rahmen der Vereinigung mit dem Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V während einzelner Tage Zeichnungen eingestellt und Rückzahlungen aufgeschoben werden (vgl. die Publikation vom 18. September 2023 betreffend den Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II und den Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V).

Dies hat zur Folge, dass beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V während des folgenden Zeitraums Zeichnungen eingestellt und Rückzahlungen aufgeschoben werden:

Teilvermögen	Zeitraum Einstellung der Ausgabe von Anteilen bzw. des Aufschubes von Rückzahlungen (geschlossen, kein Cut-off von/bis)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	20. November 2023 bis 24. November 2023

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag der Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V, der Jahres- und Halbjahresbericht sowie das Basisinformationsblatt der Anteilklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 14. November 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich