

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
IT0004645542	MEDIOBANCA SUB II 5% 15/11/20	EUR	105,4	105,52	105,48308	9	325.000	342.820
IT0000966017	INTESA S. PAOLO ZC 08/01/2027	EUR	87,96	87,96	87,96	1	25.000	21.990
XS0454984765	RBS 5,375% 30/09/2019	EUR						
IT0004608797	MEDIOBANCA PRIMO 4,50% 14/05/20	EUR						
XS0130717134	UGF ASS. TM SUB CALL 15/06/2021	EUR	100,99	100,99	100,99	2	30.000	30.297
XS0173649798	UGF ASS. TM SUB CALL 28/07/2023	EUR	101	101	101	3	125.000	126.250
XS0478074924	RABOBANK 4,125% 14/01/2020	EUR						
XS0576532054	RABOBANK 4,125% 12/01/2021	EUR						
XS0618847775	UNICREDIT 6,125% SUB 19/04/2021	EUR						
XS0500187843	INTESA S.PAOLO 4,125% 14/04/2020	EUR						
XS0526326334	INTESA S.PAOLO 5,15% SUB 16/7/20	EUR						

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
XS0617251995	CREDIT AGRICOLE 5,125% 18/04/23	EUR						
XS0496481200	RBS 5,5% 23/03/2020	EUR						
XS0452166324	INTESA S.PAOLO 5% SUB 23/9/19	EUR						
US500769EQ30	KFW 2,375% 25/08/2021	USD						
XS0597182665	BANCO BPM 7,125% SUB 1/3/21	EUR	108,4	108,4	108,4	1	100.000	108.400
XS0452314536	GENERALI 5,125% 16/09/2024	EUR	125,4	125,7	125,6	2	150.000	188.400
XS0842828120	INTESA S. PAOLO 4,375% 15/10/19	EUR						
DE000A1G0RU9	ALLIANZ FIN 3,50% 14/02/2022	EUR						
XS0497187640	LLOYDS BANK 6,50% SUB 24/03/2020	EUR						
IT0004679368	INTESA S PAOLO 5,00% 27/1/21 EST	EUR	106,75	106,75	106,75	1	100.000	106.750
DE000A1RET49	KFW 1,125% 15/1/2020	EUR						

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
XS0849517650	UNICREDIT 6,95%SUB 31/10/2022	EUR						
XS0986194883	INTESA S.PAOLO 4% 30/10/2023	EUR	114,67	114,67	114,67	1	100.000	114.670
DE000DB5DCS4	DEUTSCHE BANK 2,375% 11/01/2023	EUR						
XS0971213201	INTESA S.PAOLO SUB6,625% 13/9/23	EUR						
XS0986063864	UNICREDIT TV SUB CALL 28/10/25	EUR						
IT0001200390	INTESA SANPAOLO ZC 17/02/28	EUR	85,23	87,73	86,31455	16	726.000	626.643,6
XS1062900912	GENERALI 4,125% SUB 04/05/2026	EUR						
XS0619437147	RAIFFEISEN SUB 6,625% 18/5/21	EUR						
IT0005025389	CASSA DDPP 2,75% 31/05/2021	EUR						
DE000CB83CF0	COMMERZBANK SUB 7,75% 16/3/2021	EUR						

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
XS0555834984	BANCO BPM SUB 6% 5/11/2020	EUR	105,47	105,75	105,58929	10	700.000	739.125
XS0632503412	BANCO BPM SUB 6,375% 31/5/21	EUR						
XS0802638642	GENERALI SUB CALL TV 10/7/42	EUR	126,5	127,26	126,88	2	200.000	253.760
XS1074053130	CREDIT SUISSE 1,375% 29/11/19	EUR						
XS1077772538	BANCA INTESA 2% 18/06/2021	EUR						
IT0005068017	ICCREA BANCA TM 01/12/2019	EUR	100	100,01	100,00583	2	24.000	24.001,4
XS0195612592	CITIGROUP SUB 5,785% 1/7/24 GBP	GBP						
XS0270347304	GOLDMAN SACHS 4,75% SUB 12/10/21	EUR	108,56	108,67	108,582	2	15.000	16.287,3
XS1109765005	INTESA S.PAOLO 3,928% 15/9/26SUB	EUR						
XS1169707087	UNICREDITO TV 19/02/2020	EUR						
IT0005082448	ICCREA BANCA 2,50% 10/2/2020 USD	USD	99,08	100	99,22347	9	196.000	176.620,70416
XS1069521083	CREDIT AGRICOLE 2,375% 20/05/24	EUR						

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
XS1115479559	CREDIT SUISSE 1,375% 31/1/2022	EUR						
XS1116263325	GOLDMAN SACHS 2,125% 30/09/2024	EUR						
XS1041042828	UNIPOL ASS. 4,375% 5/03/2021	EUR						
XS1014627571	UNICREDIT 3,25% 14/01/2021	EUR						
XS1014759648	GENERALI 2,875% 14/01/2020	EUR						
XS1018032950	BANCA INTESA 3,50% 17/01/22	EUR						
XS1143070503	ICCREA BANCA 1,875% 25/11/19	EUR						
IT0004991995	ICCREA BCA 4,75%SUB SINK 14/3/21	EUR	103,1	103,25	103,13978	9	54.400	56.108,04
IT0005090813	UNICREDIT 0,75% 30/4/25 COV	EUR						
XS1205644047	BCA POP DI VICENZA 2,75% 20/3/20	EUR						
XS1206977495	UNIPOL 3% 18/3/25	EUR						

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
XS1222597905	INTESA SPAOLO 2,855% 23/04/25 SU	EUR						
IT0005108060	BCA POP EMILIA 4,25%SUB 15/06/25	EUR	102,76	103,88	103,29321	196	2.680.000	2.768.258
XS0863907522	GENERALI TV SUB CALL 12/12/2042	EUR						
IT0005067548	ICCREA BANCA 2,50% 3/12/2019 USD	USD	99,53	99,86	99,67596	19	550.000	499.018,21308
XS1246144650	INTESA S.PAOLO TV 15/6/2020	EUR						
XS1167154654	BNP PARIBAS TV 15/1/2020	EUR						
XS1197351577	INTESA SANPAOLO 1,125% 04/3/22	EUR						
XS1128148845	CITIGROUP 1,375% 27/10/2021	EUR						
XS1168003900	INTESA S.PAOLO 1,125% 14/1/2020	EUR						
IT0005090995	CASSA DDPP TM 20/03/2022	EUR	99,6	100	99,82013	20	446.000	445.197,8
IT0005136038	ICCREA BANCA TF/TV 30/09/2020	EUR	99,85	100,45	100,05701	88	2.197.000	2.198.252,5

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
IT0005139859	BANCA CARIGE 1,25% 28/1/21 COVER	EUR						
IT0005143653	ICCREA BANCA TM 16/11/2025	EUR						
XS1253955469	ABN AMRO BANK TV 30/06/2025 CALL	EUR						
XS1374865555	UNICREDIT 2% 4/3/2023	EUR						
XS0207065110	UNICREDIT 4,375% 29/1/2020	EUR						
IT0005156077	ICCREA BANCA TM 04/12/19	EUR	100	100,01	100,00286	2	140.000	140.004
IT0005171464	ICCREA BANCA TM 01/04/2021	EUR	99	100,45	99,80657	33	832.000	830.390,7
IT0005118754	ICCREA BCA 3,5% CALL SUB 29/6/25	EUR	101,6	101,6	101,6	2	80.000	81.280
XS1246834169	ICCREA BCA TV CALL SUB 18/6/25	EUR						
US370425RZ53	ALLY FINANCIAL 8% 01/11/31 USD	USD	136	136,5	136,16667	2	15.000	18.549,19712
XS1266866927	BANCO BPM 2,75% 27/7/2020	EUR						
IT0005139271	ICCREA BANCA TM 3/11/2019	EUR	99,85	100,01	99,93522	11	186.000	185.879,5

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
IT0005140188	MONTE PASCHI 1,25% 20/1/22 COVER	EUR						
XS1311440082	GENERALI TM SUB CALL 27/10/47	EUR						
US46625HNX43	JP MORGAN 2,55% 29/10/20CAL USD	USD						
XS1346762641	MEDIOBANCA 1,625% 19/01/2021	EUR						
XS1508450688	UNICREDIT 2,125% 24/10/26	EUR						
IT0005215550	ICCREA BANCA TM 14/10/21	EUR	98,7	100	99,16251	33	342.000	339.135,8
IT0005215568	ICCREA BANCA TM 14/10/21 USD	USD	98,1	98,15	98,14279	11	222.000	198.548,36982
XS0981632804	RAFFEISEN 6% 16/10/2023 SUB	EUR						
XS1234897483	KFW 9,25% 22/5/20 TRY	TRY						
XS1399387478	KFW 9,75% 17/2/21 TRY	TRY						
XS1551000364	MEDIOBANCA 0,75% 17/2/2020	EUR						
XS1551306951	INTESA S.PAOLO 1,375% 18/1/24	EUR						

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
XS1580469895	INTESA S.P. TM 15/9/27 SUB CAL	EUR	104,7	104,7	104,7	1	100.000	104.700
XS1569103259	ICCREA BANCA 1,50% 21/2/2020	EUR						
IT0005222119	ICCREA BANCA STEP UP 12/12/2020	EUR	100,04	100,05	100,04014	4	70.000	70.028,1
IT0005240335	ICCREA BANCA TM 1/2/22	EUR	97,38	99,6	98,41364	128	2.001.000	1.969.256,9
IT0005238859	BANCA POP VICENZA 0,50% 3/2/20	EUR						
IT0005239535	VENETO BANCA 0,50% 2/2/20	EUR						
XS1584041252	BNP PARIBAS TV 22/09/2022	EUR						
XS1599167589	INTESA S. PAOLO TV 19/04/2022	EUR						
XS1404902535	UBI BANCA TM 05/05/26 SUB CALL	EUR						
IT0005164568	UNICREDIT TV 16/3/23	EUR	100,5	100,5	100,5	1	10.000	10.050
DE000DB7XJJ2	DEUTSCHE BANK SUB 2,75% 17/02/25	EUR	102,15	103,5	102,49273	5	55.000	56.371
XS0481342896	INTESA S.PAOLO 5,25% 28/1/22 GBP	GBP						

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
XS1426039696	UNICREDIT TM SUB CALL 3/1/27	EUR						
XS1428773763	GENERALI TM SUB CALL 8/6/48	EUR	117,04	117,04	117,04	1	100.000	117.040
FR0013320033	SOC GEN TM 23/02/28 SUBCALL	EUR						
XS1796209010	GOLDMAN SACHS 2% 22/03/2028	EUR						
IT0005344913	ICCREA BANCA TM 26/09/2023	EUR	102,5	104,5	103,30330	54	1.136.000	1.173.525,5
IT0005353153	ICCREA BANCA 2,50% 10/12/2021	EUR	102,8	104	103,38131	77	1.791.000	1.851.559,3
FR0013260486	RCI BANQUE SA TV 14/03/2022	EUR						
US46625HRS12	JPMORGAN 3,20% 15/06/26 CALL USD	USD						
XS1686880599	BANCO BPM TM 21/09/27 SUB CALL	EUR						
XS1687277555	BANCA SELLA TM 22/09/27 SUB CALL	EUR	104,51	104,51	104,51	1	100.000	104.510
XS1696459731	ICCREA BANCA 1,50% 11/10/2022	EUR	102,8	103	102,9085	19	2.000.000	2.058.170

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
IT0005252637	ICCREA BANCA TM 23/03/21	EUR	99,2	100,3	99,96350	67	1.604.000	1.603.414,5
US172967LM17	CITIGROUP TM 24/07/2023 CALL USD	USD						
IT0005311706	ICCREA BANCA TM 15/11/2022	EUR	97,2	98,6	97,71546	34	432.000	422.130,8
XS1689739347	MEDIOBANCA 0,625% 27/9/22	EUR						
XS1694212181	BANQUE PSA FIN. 0,625% 10/10/22	EUR						
XS1699951767	INTESA SANPAOLO 0,75% 17/10/22	EUR						
XS1725580622	UNIPOL 3,5% 29/11/27 CALL	EUR						
IT0005374043	CASSA DDPP TM 28/06/2026	EUR						
XS1716607269	KFW 7,50% 10/11/2022 ZAR	ZAR						
XS1960684063	BANCO BPM 2,00% 08/03/2022	EUR	102,4	102,8	102,636	4	500.000	513.180
US172967LH22	CITIGROUP TV CALL 25/04/2022 USD	USD						
US500769HC17	KFW 1,25% 30/09/2019 USD	USD						

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
XS0606704558	BNP PARIBAS 4,50% 21/03/2023	EUR						
XS1619967182	BPER BANCA TM 31/05/27 SUB CALL	EUR	105,02	105,02	105,02	1	100.000	105.020
XS1623794457	INTESA SAN PAOLO TV 30/05/2024	EUR						
US500769EX80	KFW 2,625% 25/01/2022 USD	USD						
XS0876828541	SOCIETE GENERALE 2,25% 23/1/2020	EUR						
XS1014704586	BNP PARIBAS 2,25% 13/01/2021	EUR						
XS1603892149	MORGAN STANLEY 1,875% 27/04/2027	EUR						
XS1823532996	BNP PARIBAS TV 22/05/2023	EUR						
IT0005087116	UNICREDIT TV 03/05/2025 SUB CALL	EUR	100,41	100,58	100,50714	2	70.000	70.355
IT0005144677	BANCO BPM TM CAP 30/12/2020	EUR	98,95	99,2	99,09306	90	8.197.000	8.122.658,5
IT0005187890	BANCO BPM TM CAP 22/06/2022	EUR	97,01	98,96	97,58369	55	3.478.000	3.393.960,6