

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
IT0004645542	MEDIOBANCA SUB II 5% 15/11/20	EUR	103,71	103,96	103,77697	18	768.000	797.007,1
IT0000966017	INTESA S. PAOLO ZC 08/01/2027	EUR						
IT0004608797	MEDIOBANCA PRIMO 4,50% 14/05/20	EUR						
XS0130717134	UGF ASS. TM SUB CALL 15/06/2021	EUR	100,85	100,89	100,85190	2	105.000	105.894,5
XS0173649798	UGF ASS. TM SUB CALL 28/07/2023	EUR	101,18	101,58	101,25568	2	37.000	37.464,6
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	100,97	100,97	100,97	1	50.000	50.485
XS0526326334	INTESA S.PAOLO 5,15% SUB 16/7/20	EUR						
XS0617251995	CREDIT AGRICOLE 5,125% 18/04/23	EUR						

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
XS0496481200	RBS 5,5% 23/03/2020	EUR						
US500769EQ30	KFW 2,375% 25/08/2021	USD						
XS0597182665	BANCO BPM 7,125% SUB 1/3/21	EUR	106,21	106,38	106,295	2	200.000	212.590
XS0452314536	GENERALI 5,125% 16/09/2024	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						
DE000A1RET49	KFW 1,125% 15/1/2020	EUR						
XS0849517650	UNICREDIT 6,95%SUB 31/10/2022	EUR						
XS0986194883	INTESA S.PAOLO 4% 30/10/2023	EUR						
DE000DB5DCS4	DEUTSCHE BANK 2,375% 11/01/2023	EUR						

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
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						
XS1062900912	GENERALI 4,125% SUB 04/05/2026	EUR	116,03	116,03	116,03	1	100.000	116.030
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						
XS0555834984	BANCO BPM SUB 6% 5/11/2020	EUR	103,85	103,85	103,85	1	50.000	51.925
XS0632503412	BANCO BPM SUB 6,375% 31/5/21	EUR	106,59	106,75	106,67	2	100.000	106.670
XS0802638642	GENERALI SUB CALL TV 10/7/42	EUR						
XS1077772538	BANCA INTESA 2% 18/06/2021	EUR						

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
XS0195612592	CITIGROUP SUB 5,785% 1/7/24 GBP	GBP						
XS0270347304	GOLDMAN SACHS 4,75% SUB 12/10/21	EUR	107,38	107,56	107,44889	3	9.000	9.670,4
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	99,01	99,01	99,01	1	44.000	39.194,24202
XS1069521083	CREDIT AGRICOLE 2,375% 20/05/24	EUR						
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						

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
XS1018032950	BANCA INTESA 3,50% 17/01/22	EUR						
IT0004991995	ICCREA BCA 4,75%SUB SINK 14/3/21	EUR	101,6	101,7	101,69756	16	163.600	166.377,2
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	107,9	107,9	107,9	1	100.000	107.900
XS1222597905	INTESA SPAOLO 2,855% 23/04/25 SU	EUR						
IT0005108060	BCA POP EMILIA 4,25%SUB 15/06/25	EUR	101,8	103,1	102,40419	198	3.265.600	3.344.111,2
XS0863907522	GENERALI TV SUB CALL 12/12/2042	EUR						
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						

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
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	99,83	100,12	99,94564	15	280.000	279.847,8
IT0005136038	ICCREA BANCA TF/TV 30/09/2020	EUR	99,7	100,19	99,79595	64	1.254.000	1.251.441,2
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						
IT0005171464	ICCREA BANCA TM 01/04/2021	EUR	98,6	100	99,76142	53	2.021.000	2.016.178,2
IT0005118754	ICCREA BCA 3,5% CALL SUB 29/6/25	EUR	99,85	104	101,74986	16	146.000	148.554,8

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
XS1246834169	ICCREA BCA TV CALL SUB 18/6/25	EUR	99,8	99,8	99,8	2	200.000	199.600
US370425RZ53	ALLY FINANCIAL 8% 01/11/31 USD	USD						
XS1266866927	BANCO BPM 2,75% 27/7/2020	EUR						
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	97,92	99,9	99,42139	91	2.168.000	2.155.455,8
IT0005215568	ICCREA BANCA TM 14/10/21 USD	USD	97,3	100	99,56046	11	130.000	117.199,20931
XS0981632804	RAFFEISEN 6% 16/10/2023 SUB	EUR						
XS1234897483	KFW 9,25% 22/5/20 TRY	TRY	99,6	99,68	99,63349	2	43.000	6.537,68754

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
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						
XS1580469895	INTESA S.P. TM 15/9/27 SUB CAL	EUR						
XS1569103259	ICCREA BANCA 1,50% 21/2/2020	EUR						
IT0005222119	ICCREA BANCA STEP UP 12/12/2020	EUR	100	100,01	100,00730	6	74.000	74.005,4
IT0005240335	ICCREA BANCA TM 1/2/22	EUR	97,3	99	98,18307	283	2.737.000	2.687.270,7
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	103,5	103,5	103,5	1	100.000	103.500

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
IT0005164568	UNICREDIT TV 16/3/23	EUR						
DE000DB7XJJ2	DEUTSCHE BANK SUB 2,75% 17/02/25	EUR	104,27	105,79	105,73865	3	52.000	54.984,1
XS0481342896	INTESA S.PAOLO 5,25% 28/1/22 GBP	GBP						
XS1426039696	UNICREDIT TM SUB CALL 3/1/27	EUR	105,78	105,8	105,79	2	200.000	211.580
XS1428773763	GENERALI TM SUB CALL 8/6/48	EUR						
FR0013320033	SOC GEN TM 23/02/28 SUBCALL	EUR						
XS1796209010	GOLDMAN SACHS 2% 22/03/2028	EUR	110,75	110,75	110,75	1	100.000	110.750
IT0005344913	ICCREA BANCA TM 26/09/2023	EUR	101,6	103,8	102,80373	50	1.287.000	1.323.084
IT0005353153	ICCREA BANCA 2,50% 10/12/2021	EUR	101	102,79	101,51340	151	4.188.000	4.251.381,3
FR0013260486	RCI BANQUE SA TV 14/03/2022	EUR						
US46625HRS12	JPMORGAN 3,20% 15/06/26 CALL USD	USD	104,53	104,53	104,53	1	16.000	15.087,77627

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
IT0005158677	BCO BPM TM 29/01/21 CAPFLOOR	EUR	99,22	99,62	99,49665	189	16.374.000	16.291.581,3
XS2013745703	BCO BILBAO GREEN 1,00% 21/06/26	EUR						
XS2016160777	BCO BPM 2,50% 21/06/2024	EUR						
XS2022425297	INTESA S.PAOLO 1,00% 04/07/2024	EUR						
XS1686880599	BANCO BPM TM 21/09/27 SUB CALL	EUR						
XS1687277555	BANCA SELLA TM 22/09/27 SUB CALL	EUR						
XS1696459731	ICCREA BANCA 1,50% 11/10/2022	EUR	102,08	102,08	102,08	1	200.000	204.160
IT0005252637	ICCREA BANCA TM 23/03/21	EUR	96	99,69	98,66930	99	2.563.000	2.528.894,2
US172967LM17	CITIGROUP TM 24/07/2023 CALL USD	USD	101,73	101,73	101,73	1	10.000	9.223,86436
IT0005311706	ICCREA BANCA TM 15/11/2022	EUR	97,6	99,4	98,29929	72	840.000	825.714
XS1689739347	MEDIOBANCA 0,625% 27/9/22	EUR						
XS1694212181	BANQUE PSA FIN. 0,625% 10/10/22	EUR						

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
XS1699951767	INTESA SANPAOLO 0,75% 17/10/22	EUR						
XS1725580622	UNIPOL 3,5% 29/11/27 CALL	EUR	109,01	109,01	109,01	1	100.000	109.010
IT0005374043	CASSA DDPP TM 28/06/2026	EUR						
XS1716607269	KFW 7,50% 10/11/2022 ZAR	ZAR	102,6	104,1	103,39091	3	220.000	14.139,42710
XS1960684063	BANCO BPM 2,00% 08/03/2022	EUR						
US172967LH22	CITIGROUP TV CALL 25/04/2022 USD	USD						
XS0606704558	BNP PARIBAS 4,50% 21/03/2023	EUR						
XS1619967182	BPER BANCA TM 31/05/27 SUB CALL	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						

ISIN	Descrizione	Valuta	Prezzo Min	Prezzo Max	Prezzo Medio	Numero Contratti	Quantità negoziata	Controvalore
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	100,59	100,59	100,59	1	50.000	50.295
IT0005144677	BANCO BPM TM CAP 30/12/2020	EUR	99,33	99,76	99,66993	128	10.498.000	10.463.348,8
IT0005187890	BANCO BPM TM CAP 22/06/2022	EUR	97,33	98,02	97,82043	41	2.296.000	2.245.957