

ISIN	Descrizione	Scadenza	Valuta	Tipo Cedola	Info Cedola	Cedola %	Rend. Denaro	Q.tà Denaro	Denaro	Lettera	Q.tà Lettera	Rend. lettera	Var %	T	Sc he da
XS0290050524	BEI 4,125% 15/04/2024	15/04/2024	EUR	Fixed rate	1Y	4,13	-0,367	100.000	119,72	120,12	251.000	-0,448			
DE0001345908	BEI ZC 05/11/2026	05/11/2026	EUR	Zero Coupon			-0,078	100.000	100,54	100,94	100.000	-0,135			
US298785FH49	BEI 2,875% 15/09/2020 USD	15/09/2020	USD	Fixed rate	6M	2,88	1,778	100.000	100,83	100,93	100.000	1,646			
US298785DV50	BEI 4,875 % 15/02/2036 USD	15/02/2036	USD	Fixed rate	6M	4,88	2,245	100.000	135,51	137,32	100.000	2,135			
US459056LD78	IBRD 7,625% 19/01/2023 USD	19/01/2023	USD	Fixed rate	6M	7,63	1,836	100.000	117,41	118,25	100.000	1,584			
XS0070553820	BEI ZC 06/11/2026 USD	06/11/2026	USD	Zero Coupon			2,069	100.000	86,81	87,6	100.000	1,935			
XS0091457027	BEI 5,375% 07/06/2021 GBP	07/06/2021	GBP	Fixed rate	1Y	5,38	1,102	101.000	106,28	106,86	101.000	0,731			
XS0196448129	BEI 4,625%15/04/2020	15/04/2020	EUR	Fixed rate	1Y	4,63	-0,344	251.000	101,73	101,87	251.000	-0,729			
XS0219724878	BEI 4%15/10/37	15/10/2037	EUR	Fixed rate	1Y	4,00	0,341	251.000	163,24	164,78	251.000	0,275			
XS0427291751	BEI 4,5% 15/10/2025	15/10/2025	EUR	Fixed rate	1Y	4,50	-0,254	251.000	128,04	128,76	251.000	-0,358			
XS0544644957	BEI 3,00% 28/09/2022	28/09/2022	EUR	Fixed rate	1Y	3,00	-0,425	351.000	109,67	109,88	251.000	-0,494			
XS0505157965	BEI 4% 15/04/2030	15/04/2030	EUR	Fixed rate	1Y	4,00	0,020	100.000	141,13	141,92	100.000	-0,042			
XS0449594455	BEI TV 15/01/2020	15/01/2020	EUR	Floating rate	3M		-0,600	201.000	100,06	100,17	201.000	-1,697		=	

ISIN	Descrizione	Scadenza	Valuta	Tipo Cedola	Info Cedola	Cedola %	Rend. Denaro	Q.tà Denaro	Denaro	Lettera	Q.tà Lettera	Rend. lettera	Var %	T	Sc he da
EU000A1GVJX6	EUROPEAN UNION 2,75% 21/09/2021	21/09/2021	EUR	Fixed rate	1Y	2,75	-0,377	251.000	105,6	105,99	251.000	-0,584			
EU000A1GVVF8	EUROPEAN UNION 3,00% 04/09/2026	04/09/2026	EUR	Fixed rate	1Y	3,00	-0,088	251.000	120,87	122,49	251.000	-0,300			
XS0755873253	BEI 3,50% 15/04/2027	15/04/2027	EUR	Fixed rate	1Y	3,50	-0,189	251.000	127,32	128,07	251.000	-0,277			
XS0676294696	BEI 2,75% 15/09/2021	15/09/2021	EUR	Fixed rate	1Y	2,75	-0,437	251.000	105,66	105,92	251.000	-0,577			
EU000A1G0AB4	EFSF 3,375% 05/07/2021	05/07/2021	EUR	Fixed rate	1Y	3,38	-0,489	251.000	106,1	106,34	100.000	-0,633			
EU000A1G0AD0	EFSF 3,50% 04/02/2022	04/02/2022	EUR	Fixed rate	1Y	3,50	-0,429	251.000	108,52	108,67	100.000	-0,494			
EU000A1G0BK3	EFSF 1,75% 29/10/2020	29/10/2020	EUR	Fixed rate	1Y	1,75	-0,443	251.000	101,95	102,1	251.000	-0,608			
XS0975634204	BEI 3% 14/10/2033	14/10/2033	EUR	Fixed rate	1Y	3,00	0,214	251.000	137,96	139,39	100.000	0,128			
EU000A1U9803	EFSF 2,125% 20/11/2023	20/11/2023	EUR	Fixed rate	1Y	2,13	-0,207	100.000	109,25	111,25	100.000	-0,679			
XS0524597613	COUNCIL OF EUROPE 3% 13/7/2020	13/07/2020	EUR	Fixed rate	1Y	3,00	-0,049	100.000	101,8	102,8	100.000	-1,677			
XS0884635524	BEI 2,75% 15/03/2040	15/03/2040	EUR	Fixed rate	1Y	2,75	0,469	251.000	143,98	146,22	251.000	0,376			
EU000A1G0BG1	EFSF 1,625% 17/07/2020	17/07/2020	EUR	Fixed rate	1Y	1,63	-0,381	251.000	101,21	101,4	251.000	-0,690			
XS0888089082	BEI 1,625% 16/03/2020 USD	16/03/2020	USD	Fixed rate	6M	1,63	1,882	100.000	99,93	100,02	100.000	1,544			

ISIN	Descrizione	Scadenza	Valuta	Tipo Cedola	Info Cedola	Cedola %	Rend. Denaro	Q.tà Denaro	Denaro	Lettera	Q.tà Lettera	Rend. lettera	Var %	T	Sc he da
XS0942172296	BEI 2% 14/04/2023	14/04/2023	EUR	Fixed rate	1Y	2,00	-0,392	251.000	108,07	108,88	251.000	-0,619			
EU000A1G0AJ7	EFSF 3,875% 30/03/2032	30/03/2032	EUR	Fixed rate	1Y	3,88	0,164	251.000	145,16	146,55	251.000	0,073			
EU000A1G0AT6	EFSF 3,375% 03/04/2037	03/04/2037	EUR	Fixed rate	1Y	3,38	0,410	100.000	149,45	150,87	100.000	0,344			
EU000A1G6TV9	EUROPEAN UNION 2,875% 04/04/2028	04/04/2028	EUR	Fixed rate	1Y	2,88	-0,009	251.000	124	125,99	251.000	-0,218			
XS0858366098	BEI 1,375% 15/09/2020	15/09/2020	EUR	Fixed rate	1Y	1,38	-0,409	251.000	101,37	101,51	251.000	-0,588			
XS0878008225	BEI 2,625% 15/03/2035	15/03/2035	EUR	Fixed rate	1Y	2,63	0,318	251.000	134,32	136,7	251.000	0,184			
XS0918749622	BEI 1,375% 15/09/2021	15/09/2021	EUR	Fixed rate	1Y	1,38	-0,432	251.000	103,21	103,43	251.000	-0,553			
XS1068872925	BEI 1,625% 15/03/2023	15/03/2023	EUR	Fixed rate	1Y	1,63	-0,352	251.000	106,5	106,83	251.000	-0,448			
EU000A1G0BP2	EFSF 1,375% 07/06/2021	07/06/2021	EUR	Fixed rate	1Y	1,38	-0,412	100.000	102,68	102,83	100.000	-0,509			
XS1023039545	BEI 2,125% 15/01/2024	15/01/2024	EUR	Fixed rate	1Y	2,13	-0,310	100.000	110,06	110,53	100.000	-0,417			
XS0605996700	BEI 9% 31/3/2021 ZAR	31/03/2021	ZAR	Fixed rate	1Y	9,00	6,609	700.000	102,84	103,07	700.000	6,425			
XS0984173624	BEI 7,5% 15/1/2020 ZAR	15/01/2020	ZAR	Fixed rate	1Y	7,50	8,174	700.000	99,88	100,15	700.000	5,593			
XS1059896016	BEI 10,50% 29/4/2024 TRY	29/04/2024	TRY	Fixed rate	1Y	10,50	9,819	200.000	102,22	103,88	510.000	9,349		=	

ISIN	Descrizione	Scadenza	Valuta	Tipo Cedola	Info Cedola	Cedola %	Rend. Denaro	Q.tà Denaro	Denaro	Lettera	Q.tà Lettera	Rend. lettera	Var %	T	Sc he da
XS1072624072	BEI 8,25% 13/9/2021 ZAR	13/09/2021	ZAR	Fixed rate	1Y	8,25	6,631	700.000	102,56	103,11	700.000	6,299			
XS1098105254	BEI 8,75% 6/7/2020 TRY	06/07/2020	TRY	Fixed rate	1Y	8,75	10,690	150.000	98,74	100,49	150.000	7,571			
XS1105947714	BEI 7,50% 10/09/2020 ZAR	10/09/2020	ZAR	Fixed rate	1Y	7,50	6,649	700.000	100,52	101,95	700.000	4,724			
XS1110395933	BEI 8,50% 17/09/24 ZAR	17/09/2024	ZAR	Fixed rate	1Y	8,50	7,034	700.000	105,72	106,3	700.000	6,893			
XS1115184753	BEI 9,25% 3/10/2024 TRY	03/10/2024	TRY	Fixed rate	1Y	9,25	9,260	150.000	99,9	100,6	150.000	9,075			
XS1139474206	BEI 8% 1/4/2020 TRY	01/04/2020	TRY	Fixed rate	1Y	8,00	10,976	150.000	98,93	101	100.000	4,469		=	
XS1167524922	BEI 8,125% 21/12/26 ZAR	21/12/2026	ZAR	Fixed rate	1Y	8,13	7,390	700.000	103,91	104,33	700.000	7,314			
XS1224031903	BEI 9,125% 7/10/2020 TRY	07/10/2020	TRY	Fixed rate	1Y	9,13	10,054	150.000	99,17	99,61	150.000	9,483		=	
US29874QCH56	EBRD 1,5% 16/03/20 USD	16/03/2020	USD	Fixed rate	6M	1,50	2,435	100.000	99,75	100,35	100.000	0,186			
US298785FM34	BEI 4% 16/2/21 USD	16/02/2021	USD	Fixed rate	6M	4,00	1,760	100.000	102,61	102,86	100.000	1,550			
US298785GJ95	BEI 3,25% 29/01/24 USD	29/01/2024	USD	Fixed rate	6M	3,25	1,750	100.000	105,96	106,1	100.000	1,716		=	
US298785GL42	BEI 2,5% 15/4/21 USD	15/04/2021	USD	Fixed rate	6M	2,50	1,737	100.000	101,01	101,14	100.000	1,640			
US459058CY72	IBRD 2,125% 13/2/23 USD	13/02/2023	USD	Fixed rate	6M	2,13	1,757	100.000	101,13	102,06	100.000	1,458			
US298785HD17	BEI 2,125% 13/4/26 USD	13/04/2026	USD	Fixed rate	6M	2,13	1,915	100.000	101,25	102,6	100.000	1,691			

ISIN	Descrizione	Scadenza	Valuta	Tipo Cedola	Info Cedola	Cedola %	Rend. Denaro	Q.tà Denaro	Denaro	Lettera	Q.tà Lettera	Rend. lettera	Var %	T	Sc he da
US4581X0CD88	IADB 2,125% 09/11/2020 USD	09/11/2020	USD	Fixed rate	6M	2,13	1,888	100.000	100,22	101,57	100.000	0,402			
XS0114126294	BEI 5,625% 07/06/2032 GBP	07/06/2032	GBP	Fixed rate	1Y	5,63	1,325	101.000	149,19	150,77	101.000	1,218			
XS0295479983	BEI 4,50% 07/03/2044 GBP	07/03/2044	GBP	Fixed rate	1Y	4,50	1,494	101.000	160,75	161,66	101.000	1,461			
XS0740808802	BEI 3,875% 08/06/2037 GBP	08/06/2037	GBP	Fixed rate	1Y	3,88	1,435	101.000	137,5	139,4	101.000	1,334			
XS0768478868	BEI 3,75% 07/12/2027 GBP	07/12/2027	GBP	Fixed rate	1Y	3,75	1,117	101.000	120,02	121,86	101.000	0,903			
XS0849420905	BEI 2,50% 31/10/2022 GBP	31/10/2022	GBP	Fixed rate	1Y	2,50	0,984	101.000	104,3	105,21	101.000	0,674			
XS1416470323	BEI 1,125% 07/09/2021 GBP	07/09/2021	GBP	Fixed rate	1Y	1,13	1,060	101.000	100,11	100,68	101.000	0,731			
XS0318345971	BEI 0 COUPON 5/9/22 TRY	05/09/2022	TRY	Zero Coupon			11,167	150.000	74,84	75,56	150.000	10,779			
XS1075219763	BEI 8,75% 18/9/21 TRY	18/09/2021	TRY	Fixed rate	1Y	8,75	9,492	150.000	98,77	100	100.000	8,710			
XS1388868165	BEI 0 COUPON 5/4/24 TRY	05/04/2024	TRY	Zero Coupon			10,518	150.000	64,92						
XS0084291201	EBRD 0 COUPON 31/12/29 ZAR	31/12/2029	ZAR	Zero Coupon			8,439	700.000	44,27	47,59	700.000	7,662			
XS1566126345	BEI 0 COUPON 16/2/27 TRY	16/02/2027	TRY	Zero Coupon			9,808	150.000	51,05						
XS1568905969	IBRD 0 COUPON 24/2/20 TRY	24/02/2020	TRY	Zero Coupon			11,055	150.000	97,75						
EU000A1G0DY0	EFSF 0,875% 26/07/2027	26/07/2027	EUR	Fixed rate	1Y	0,88	0,000	251.000	106,67	108,13	251.000	-0,183			

ISIN	Descrizione	Scadenza	Valuta	Tipo Cedola	Info Cedola	Cedola %	Rend. Denaro	Q.tà Denaro	Denaro	Lettera	Q.tà Lettera	Rend. lettera	Var %	T	Sc he da
EU000A1G0D39	EFSF 0,125% 17/10/2023	17/10/2023	EUR	Fixed rate	1Y	0,13	-0,157	251.000	101,09	102,48	251.000	-0,511			
XS1753042743	BEI 1,50% 16/10/2048	16/10/2048	EUR	Fixed rate	1Y	1,50	0,586	251.000	124,19	127,07	251.000	0,491			
XS1490971634	BEI 1,125% 16/9/21 CAD	16/09/2021	CAD	Fixed rate	6M	1,13	1,789	100.000	98,85	100,31	100.000	0,947			
EU000A1G0DT0	EFSF 1,25% 24/05/2033	24/05/2033	EUR	Fixed rate	1Y	1,25	0,320	100.000	112,22	114,36	100.000	0,169			
US298785HL33	BEI USD 1,625% 14/08/2020	14/08/2020	USD	Fixed rate	6M	1,63	1,806	100.000	99,88	100,01	100.000	1,611			
US298785HM16	BEI USD 2,375% 24/05/2027	24/05/2027	USD	Fixed rate	6M	2,38	1,856	100.000	103,6	104,26	100.000	1,763			
EU000A1G0D70	EFSF 0,95% 14/2/28	14/02/2028	EUR	Fixed rate	1Y	0,95	0,051	251.000	107,34	109,29	251.000	-0,176			
US298785HQ20	BEI 2,375% 13/05/21 USD	13/05/2021	USD	Fixed rate	6M	2,38	1,732	100.000	100,9	101,06	100.000	1,619			
XS1756305469	BEI 0,875% 15/03/21 GBP	15/03/2021	GBP	Fixed rate	1Y	0,88	0,858	101.000	100,02	100,17	101.000	0,739		=	
XS0941866252	IBRD 7,00% 07/06/2023 ZAR	07/06/2023	ZAR	Fixed rate	1Y	7,00	6,242	700.000	102,26	105,95	700.000	5,084		=	
XS1500338618	BEI 0,50% 13/11/2037	13/11/2037	EUR	Fixed rate	1Y	0,50	0,349	100.000	102,62	105,48	100.000	0,189			
XS1861204938	BEI 17,00% 03/02/2023 TRY	03/02/2023	TRY	Fixed rate	1Y	17,00	11,163	150.000	114,71						
XS1791485011	BEI 0,875% 14/01/2028	14/01/2028	EUR	Fixed rate	1Y	0,88	-0,060	250.000	107,59	108,57	250.000	-0,175			
XS1274823571	BEI 8,75% 18/08/2025 ZAR	18/08/2025	ZAR	Fixed rate	1Y	8,75	7,176	700.000	107,08	107,87	700.000	7,011			

ISIN	Descrizione	Scadenza	Valuta	Tipo Cedola	Info Cedola	Cedola %	Rend. Denaro	Q.tà Denaro	Denaro	Lettera	Q.tà Lettera	Rend. lettera	Var %	T	Sc he da
XS1574041999	BEI 10,00% 07/03/2022 TRY	07/03/2022	TRY	Fixed rate	1Y	10,00	9,738	150.000	100,42	103,08	150.000	8,397			
XS1620777083	IBRD ZC 26/05/2027 TRY	26/05/2027	TRY	Zero Coupon			9,886	150.000	49,5	52,7	150.000	8,967			
XS1664203699	IBRD 10,00% 16/08/2021 TRY	16/08/2021	TRY	Fixed rate	1Y	10,00	10,531	150.000	99,11	100,52	150.000	9,585			
XS1179347999	BEI 7,25% 28/02/2023 ZAR	28/02/2023	ZAR	Fixed rate	1Y	7,25	6,513	700.000	102,06	104,85	700.000	5,558			
XS1490724975	BEI 1,00% 21/09/2026 GBP	21/09/2026	GBP	Fixed rate	1Y	1,00	0,991	101.000	100,06	100,71	101.000	0,892			
XS1548413696	BEI 0,625% 17/01/2020 GBP	17/01/2020	GBP	Fixed rate	1Y	0,63	1,100	101.000	99,95	100,04	101.000	0,239			
XS1679039328	BEI 0,875% 15/12/2023 GBP	15/12/2023	GBP	Fixed rate	1Y	0,88	0,990	101.000	99,55	100,59	101.000	0,725			
XS1805260483	BEI 1,375% 07/03/2025 GBP	07/03/2025	GBP	Fixed rate	1Y	1,38	1,114	101.000	101,32	102,4	101.000	0,904			
XS1811852109	BEI 2,875% 13/06/2025 USD	13/06/2025	USD	Fixed rate	6M	2,88	1,860	100.000	105,29	106,27	100.000	1,679			
US298785GS94	BEI 1,875% 10/02/2025 USD	10/02/2025	USD	Fixed rate	6M	1,88	1,755	100.000	100,59	100,83	100.000	1,706		=	
US298785GX89	BEI 2,25% 15/08/2022 USD	15/08/2022	USD	Fixed rate	6M	2,25	1,747	100.000	101,31	101,61	100.000	1,633			
XS1068966073	BEI TV 21/05/2021 GBP	21/05/2021	GBP	Floating rate	3M	1,00	0,858	101.000	100,2	100,39	101.000	0,726			
XS1507486584	BEI 1,50% 21/11/2026 CALL USD	21/11/2026	USD	Fixed rate	1Y	1,50	2,251	100.000	95,22	97,31	100.000	1,917			

ISIN	Descrizione	Scadenza	Valuta	Tipo Cedola	Info Cedola	Cedola %	Rend. Denaro	Q.tà Denaro	Denaro	Lettera	Q.tà Lettera	Rend. lettera	Var %	T	Sc he da
XS1605368536	BEI 8,00% 05/05/2027 ZAR	05/05/2027	ZAR	Fixed rate	1Y	8,00	7,403	700.000	103,24	103,41	700.000	7,373			
XS1807207581	BEI 11,00% 20/04/2026 TRY	20/04/2026	TRY	Fixed rate	1Y	11,00	9,874	150.000	105,02	106,35	150.000	9,595		=	
CA459058EY56	IBRD 1,25% 18/03/2021 CAD	18/03/2021	CAD	Fixed rate	6M	1,25	1,889	100.000	99,2	100,05	70.000	1,210		=	
XS1198022706	IBRD 8,25% 04/03/2022 TRY	04/03/2022	TRY	Fixed rate	1Y	8,25	9,479	150.000	97,56	98,32	150.000	9,082			
US298785GP55	BEI 2,125% 15/10/2021 USD	15/10/2021	USD	Fixed rate	6M	2,13	1,710	100.000	100,75	100,88	100.000	1,639			
US298785GQ39	BEI 2,50% 15/10/2024 USD	15/10/2024	USD	Fixed rate	6M	2,50	1,846	100.000	103,02	103,74	100.000	1,693			
US298785GV24	BEI 1,375% 15/06/2020 USD	15/06/2020	USD	Fixed rate	6M	1,38	1,787	100.000	99,79	99,9	100.000	1,571			
XS0765766703	BEI TV 04/01/2022	04/01/2022	EUR	Floating rate	3M	0,08	-0,286	201.000	100,76	102,22	201.000	-0,970			
XS0907250509	BEI TV 15/01/2021	15/01/2021	EUR	Floating rate	3M		-0,161	201.000	100,18	101,59	201.000	-1,410			
XS1031001198	BEI TV 17/02/2020 GBP	17/02/2020	GBP	Floating rate	3M	1,04	1,039	101.000	100	100,13	101.000	0,352			