

XAIA Credit

Halbjahresbericht zum 30. Juni 2023

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

R.C.S. Lux K1169



XAIA Credit

Inhalt

Organisationsstruktur	3
Bericht des Vorstands	4
Erläuterungen zur Vermögensaufstellung	5 - 10
Konsolidierte Vermögensaufstellung	11
XAIA Credit Basis	
Vermögensübersicht	12
Vermögensaufstellung	13 - 16
Derivate	17 - 45
Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre	46 - 48
XAIA Credit Basis II	
Vermögensübersicht	49
Vermögensaufstellung	50 - 54
Derivate	55 - 89
Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre / seit Auflegung	90 - 93
XAIA Credit Debt Capital	
Vermögensübersicht	94
Vermögensaufstellung	95 - 98
Derivate	99 - 117
Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre / seit Auflegung	118 - 122
Anlagen	
Anlage 1: Allgemeine Angaben	123 - 125
Anlage 2: Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012	126 - 129
Anlage 3: Angaben gemäß Verordnung (EU) 2019/2088 über die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken in den Investmentprozess	130

Organisationsstruktur

Verwaltungsgesellschaft & Zentralverwaltungsstelle

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

Aufsichtsrat der Verwaltungsgesellschaft

Vorsitzender des Aufsichtsrats

Michael Reinhard (bis 25. Mai 2023)
Sprecher der Geschäftsführung der
Universal-Investment-Gesellschaft mbH, D - 60486 Frankfurt am Main

Frank Eggloff (ab 25. Mai 2023)
Geschäftsführer der
Universal-Investment-Gesellschaft mbH, D - 60486 Frankfurt am Main

Mitglieder des Aufsichtsrats

Frank Eggloff (bis 25. Mai 2023)
Geschäftsführer der
Universal-Investment-Gesellschaft mbH, D - 60486 Frankfurt am Main

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

Vorstand der Verwaltungsgesellschaft

Vorsitzende des Vorstands

Dr. Sofia Harrschar

Mitglieder des Vorstands

Matthias Müller

Martin Groos

Bernhard Heinz

Verwahrstelle, Register- und Transferstelle

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

Portfoliomanager

XAIA Investment GmbH
Sonnenstraße 19, D - 80339 München

Zahlstelle

Luxemburg

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

Bundesrepublik Deutschland

Baader Bank AG
Weihenstephaner Straße 4, D - 85716 Unterschleißheim

Österreich

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

Vertriebsstelle

Bundesrepublik Deutschland

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

Österreich

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

Cabinet de révision agréé

KPMG Audit S.à r.l.
39, Avenue John F. Kennedy, L - 1855 Luxemburg

XAIA Credit

Bericht des Vorstands

Sehr geehrte Damen und Herren,

wir legen Ihnen hiermit den Halbjahresbericht des XAIA Credit mit seinen Teilfonds XAIA Credit Basis, XAIA Credit Basis II und XAIA Credit Debt Capital vor.
Der Bericht umfasst den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zum 30. Juni 2023.

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

Michael Reinhard schied zum 25. Mai 2023 aus dem Aufsichtsrat des AIFM aus. Ab dem 25. Mai 2023 ist Frank Eggloff Vorsitzender des Aufsichtsrats des AIFM.

Die Ukraine-Krise und die dadurch ausgelösten Marktturbulenzen und Sanktionen der Industrienationen gegenüber Russland haben eine Vielzahl an unterschiedlichen Auswirkungen auf die Finanzmärkte im Allgemeinen und auf Fonds im Speziellen. Die Bewegungen an den Börsen können sich entsprechend auch im Fondsvermögen widerspiegeln.

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

Zum 30. Juni 2023 stellen sich das Fondsvermögen sowie die Kursentwicklung des Fonds im Berichtszeitraum wie folgt dar:

Anteilklasse	ISIN	Fondsvermögen in EUR	Kursentwicklung in % *)
XAIA Credit Basis (I)	LU0418282934	207.369.447,34	1,68
XAIA Credit Basis (G)	LU0418282348	58.132,21	1,19
XAIA Credit Basis (IT)	LU0946790523	81.042.648,42	1,68
XAIA Credit Basis II (I)	LU0462885301	282.393.805,91	1,97
XAIA Credit Basis II (P)	LU0462885483	4.455.689,45	1,65
XAIA Credit Basis II (IT)	LU0946790796	192.035.828,17	1,97
XAIA Credit Basis II (R)	LU2194006594	1.564.022,55	1,94
XAIA Credit Debt Capital (I)	LU0644384843	35.047.080,31	2,71
XAIA Credit Debt Capital (P)	LU0644385733	4.041.525,90	2,44
XAIA Credit Debt Capital (V)	LU0880249403	37.402.318,33	2,70
XAIA Credit Debt Capital (IT)	LU0946790952	161.476.524,63	2,71
XAIA Credit Debt Capital (R)	LU2194006164	3.345.044,86	2,66

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

Erläuterungen zur Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

Allgemeines

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

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

Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze

Der Halbjahresbericht wird in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Halbjahresberichts sowie unter der Annahme der Unternehmensfortführung, aufgestellt.

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

Das jeweilige Teilfondsvermögen wird nach folgenden Grundsätzen berechnet:

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

Erläuterungen zur Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

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

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

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

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

Realisierte Gewinne/Verluste aus Wertpapierverkäufen

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

Bewertung von Optionen

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

Bewertung von Termingeschäften

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

Bewertung von Devisentermingeschäften

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

Devisenkurse

Per 30. Juni 2023 wurden die Bewertungen der Fremdwährungspositionen unter Verwendung der nachstehenden Devisenkurse in die Fondswährung umgerechnet:

Währung	Kurs
EUR - CHF	0,9758
EUR - GBP	0,8579
EUR - JPY	157,6569
EUR - USD	1,0909
EUR - ZAR	20,6023

Erläuterungen zur Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

Verwaltungsvergütung

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

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

Performance Fee

Für alle Anteilklassen des XAIA Credit Basis

Keine

Für alle Anteilklassen des XAIA Credit Basis II

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

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

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

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

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

Erläuterungen zur Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

Performance Fee (Fortsetzung)

Für alle Anteilklassen des XAIA Credit Debt Capital

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

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

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

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

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

Teilfonds	Performance Fee in %	Tatsächlich erhobene Performance Fee in EUR
XAIA Credit Debt Capital (I)	0,68	130.372,32
XAIA Credit Debt Capital (P)	0,54	10.496,50
XAIA Credit Debt Capital (V)	0,69	146.941,43
XAIA Credit Debt Capital (IT)	0,69	541.127,64
XAIA Credit Debt Capital (R)	0,66	10.192,23

Verwahrstelle-, Registerstellen- und Transfer- sowie Zahlstellenvergütung

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

Erläuterungen zur Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

Transaktionskosten

Für den am 30. Juni 2023 endenden Berichtszeitraum sind für den XAIA Credit im Zusammenhang mit dem Kauf und Verkauf von Wertpapieren, Geldmarktpapieren, Derivaten oder anderen Vermögensgegenständen folgende Transaktionskosten angefallen:

Teilfonds	Transaktionskosten in EUR
XAIA Credit Basis	16.939,00
XAIA Credit Basis II	20.948,00
XAIA Credit Debt Capital	257.507,61

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

Sonstige Kosten

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

Besteuerung

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

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

Veröffentlichungen

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

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

Erläuterungen zur Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

Veränderungen im Wertpapierbestand

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

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Die Ukraine-Krise und die dadurch ausgelösten Marktturbulenzen und Sanktionen der Industrienationen gegenüber Russland haben eine Vielzahl an unterschiedlichen Auswirkungen auf die Finanzmärkte im Allgemeinen und auf Fonds im Speziellen. Die Bewegungen an den Börsen können sich entsprechend auch im Fondsvermögen widerspiegeln.

XAIA Credit

Die konsolidierte Vermögensaufstellung setzt sich aus der Summe aller Teilfonds zusammen.

Konsolidierte Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen *)
Aktiva		
Wertpapiervermögen	817.189.197,24	80,89
Derivate	58.351.665,71	5,78
Bankguthaben	175.463.341,72	17,37
Zinsansprüche	11.857.303,50	1,17
Zinsansprüche Swaps	6.874.899,97	0,68
Sonstige Forderungen	48.134,93	0,00
Gesamtaktiva	1.069.784.543,07	105,89
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme	-49.217.458,55	-4,87
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	-4.594.848,32	-0,45
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsvergütung	-570.534,71	-0,06
Verbindlichkeiten aus Performance Fee	-838.815,55	-0,08
Verbindlichkeiten aus Verwahrstellenvergütung	-28.476,61	-0,00
Verbindlichkeiten aus Depotgebühren	-100.782,72	-0,01
Rückstellungen für Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	-36.000,01	-0,00
Taxe d'abonnement	-26.584,17	-0,00
Verbindlichkeiten aus Cash Collateral	-4.000.000,00	-0,40
Sonstige Verbindlichkeiten	-138.974,34	-0,01
Gesamtpassiva	-59.552.474,98	-5,89
Fondsvermögen	1.010.232.068,08	100,00

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

XAIA Credit Basis

Vermögensübersicht zum 30.06.2023

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen *)
I. Vermögensgegenstände	308.224.489,80	106,81
1. Anleihen	243.696.532,22	84,48
2. Derivate	15.585.060,64	5,40
3. Bankguthaben	43.685.591,91	15,14
4. Sonstige Vermögensgegenstände	5.257.305,03	1,79
II. Verbindlichkeiten	-19.754.261,83	-6,81
III. Fondsvermögen	288.470.227,97	100,00

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

XAIA Credit Basis

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2023	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
Bestandspositionen				EUR		243.696.532,22	84,48
Börsengehandelte Wertpapiere				EUR		94.889.491,31	32,89
Verzinsliche Wertpapiere				EUR		94.889.491,31	32,89
1,0000 % Teva Pharmac.Fin.NL IV B.V. SF-Schuldversch. 2016(25)	CH0333827506	%	1.675	CHF	94,213	1.617.195,84	0,56
5,6000 % Commerzbank AG Nachr.Inh.Schv.A.N317 v.03(23)	DE0001611044	%	1.670	EUR	99,996	1.669.936,61	0,58
5,0000 % SoftBank Group Corp. EO-Notes 2018(18/28)	XS1793255941	%	14.550	EUR	92,827	13.506.301,77	4,68
2,8750 % SoftBank Group Corp. EO-Notes 2021(21/27)	XS2361254597	%	1.770	EUR	88,026	1.558.057,10	0,54
4,1770 % UBS Group AG EO-FLR Med.-T. Nts 2021(25/26)	CH0591979635	%	41.563	EUR	98,329	40.868.447,28	14,17
4,0000 % B.A.T. Intl Finance PLC LS-Medium-Term Notes 2013(26)	XS0969309847	%	2.000	GBP	91,293	2.128.298,08	0,74
5,1250 % Ladbrokes Group Finance PLC LS-Notes 2016(16/23)	XS1514268165	%	4.700	GBP	99,588	5.455.910,58	1,89
7,3850 % Barclays PLC DL-FLR Notes 2022(22/28)	US06738ECD58	%	3.000	USD	104,076	2.862.117,20	0,99
6,9500 % Bath & Body Works Inc. DL-Debts 2003(03/33)	US532716AK37	%	6.400	USD	89,149	5.230.091,11	1,81
7,6000 % Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2007(07/37)	US532716AN75	%	3.000	USD	88,447	2.432.322,07	0,84
4,7550 % HSBC Holdings PLC DL-FLR Notes 2022(22/28)	US404280DF39	%	11.000	USD	95,854	9.665.405,41	3,35
7,7670 % Standard Chartered PLC DL-FLR Notes 2022(27/28) 144A	US853254CN89	%	6.500	USD	106,061	6.319.544,96	2,19
5,7500 % Türkei, Republik DL-Notes 2017(47)	US900123CM05	%	2.500	USD	68,764	1.575.863,30	0,55
An regulierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				EUR		126.101.431,89	43,71
Verzinsliche Wertpapiere				EUR		126.101.431,89	43,71
3,1250 % Aramark Intl Finance S.à.r.l. EO-Notes 2017(17/25) Reg.S	XS1586831999	%	2.200	EUR	95,515	2.101.334,45	0,73
0,1250 % Argentinien, Republik EO-Notes 2020(20/24-30)	XS2177363665	%	4.500	EUR	27,981	1.259.142,83	0,44
7,6250 % Carnival Corp. EO-Notes 2020(20/26) Reg.S	XS2264155305	%	7.550	EUR	97,280	7.344.649,07	2,55
3,6250 % Netflix Inc. EO-Notes 2019(19/30) Reg.S	XS2072829794	%	1.000	EUR	95,275	952.746,68	0,33
3,7500 % Stena International S.A. EO-Notes 2020(20/25) Reg.S	XS2110768525	%	900	EUR	96,513	868.619,40	0,30
9,0730 % Stonegate Pub Comp.Fin.19 PLC EO-FLR Notes 2020(20/25) Reg.S	XS2210013970	%	5.100	EUR	93,167	4.751.499,63	1,65
4,5000 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. EO-Notes 2018(18/25)	XS1813724603	%	1.234	EUR	98,755	1.218.631,43	0,42
3,7500 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. EO-Notes 2021(21/27)	XS2406607098	%	2.380	EUR	90,213	2.147.074,90	0,74
6,6250 % TK Elevator Holdco GmbH Anleihe v.20(20/28) Reg.S	XS2198191962	%	3.600	EUR	85,650	2.775.043,86	0,96
5,2500 % Verisure Midholding AB EO-Notes 2021(21/29) Reg.S	XS2287912450	%	3.775	EUR	86,514	3.265.885,27	1,13
6,6250 % Amkor Technology Inc. DL-Notes 2019(19/27) 144A	US031652BK50	%	1.600	USD	99,564	1.460.284,53	0,51
6,3750 % Aramark Services Inc. DL-Notes 2020(20/25) 144A	US038522AR99	%	2.000	USD	99,885	1.831.231,90	0,63
5,7500 % Avient Corp. DL-Notes 2020(20/25)	US73179PAM86	%	7.005	USD	98,405	6.318.887,68	2,19
4,7500 % Boyd Gaming Corp. DL-Notes 2020(20/27)	US103304BU40	%	1.750	USD	94,573	1.517.117,42	0,53
3,5470 % Deutsche Bank AG FLR-DL-Senior Nts v.20(30/31)	US251526CD98	%	3.000	USD	82,576	2.270.861,08	0,79
6,2500 % Expedia Group Inc. DL-Notes 2020(20/25) 144A	US30212PAS48	%	2.000	USD	100,056	1.834.371,40	0,64
5,1250 % Howmet Aerospace Inc. DL-Notes 2014(14/24)	US013817AW16	%	2.316	USD	98,722	2.095.892,31	0,73
8,2480 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-FLR Pref.MTN 22(32/33) 144A	US46115HBV87	%	8.000	USD	104,723	7.679.759,83	2,66

XAIA Credit Basis

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2023	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
6,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-Notes 2023(33) 144A X	US46115HBZ91	%	7.500	USD	99,111	6.813.944,19	2,36
7,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-Pref.Med.-T.Nts 22(25) 144A	US46115HBU05	%	3.500	USD	100,933	3.238.305,90	1,12
4,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-Receipts 2019(29) Cl.X 144A	US46115HBL06	%	7.600	USD	86,957	6.058.029,47	2,10
4,8750 % Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	US46284VAC54	%	1.000	USD	93,525	857.322,17	0,30
5,0000 % Iron Mountain Inc. DL-Notes 2020(20/28) 144A	US46284VAG68	%	1.455	USD	91,951	1.226.412,72	0,43
3,6250 % Louisiana Pacific Corp. DL-Notes 2021(21/29) 144A	US546347AM73	%	3.350	USD	86,608	2.659.611,48	0,92
5,2500 % MGIC Investment Corp. DL-Notes 2020(20/28)	US552848AG81	%	3.936	USD	93,920	3.388.646,62	1,17
4,3450 % Nissan Motor Co. Ltd. DL-Notes 2020(20/27) 144A	US654744AC50	%	2.978	USD	90,723	2.476.603,93	0,86
4,8100 % Nissan Motor Co. Ltd. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USJ57160DZ32	%	11.400	USD	87,253	9.118.043,09	3,16
5,3750 % Ovitiv Inc. DL-Notes 2015(15/26)	US651290AR99	%	6.050	USD	98,967	5.488.588,88	1,90
7,9500 % Pactiv LLC DL-Notes 1999(25)	US880394AB71	%	2.388	USD	101,293	2.217.315,72	0,77
6,6250 % Radian Group Inc. DL-Notes 2020(20/25)	US750236AX98	%	2.300	USD	99,908	2.106.401,77	0,73
1,4880 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 20(25/26)Reg.S	US83368TAZ12	%	7.000	USD	87,836	5.636.196,86	1,95
2,7970 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 22(27/28)Reg.S	US83368TBH05	%	2.500	USD	88,187	2.020.972,61	0,70
6,4460 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 23(28/29) 144A	US83368RBR21	%	3.000	USD	100,131	2.753.631,02	0,95
7,8750 % Sprint Corp. DL-Notes 2014(14/23)	US85207UAF21	%	9.400	USD	100,243	8.637.638,43	2,99
7,6250 % Sprint Corp. DL-Notes 2018(18/26)	US85207UAK16	%	5.150	USD	103,705	4.895.802,76	1,70
7,0000 % Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S	USW8758PAK22	%	1.948	USD	99,770	1.781.569,34	0,62
7,5000 % Transdigm Inc. DL-Notes 2019(19/27)	US893647BH98	%	2.000	USD	99,550	1.825.100,29	0,63
1,9820 % UniCredit S.p.A. DL-FLR Pref. MTN 2021(26/27)	XS2348710562	%	1.500	USD	87,873	1.208.260,97	0,42
				EUR		22.705.609,02	7,87
Verzinsliche Wertpapiere				EUR		22.705.609,02	7,87
0,0000 % Banco Espirito Santo S.A. EO-Medium-Term Notes 2011(16)	PTBEQBOM0010	%	3.000	EUR	23,009	690.264,24	0,24
0,0000 % Galapagos Holding S.A. EO-Notes 2014(17/22) Reg.S	XS1071420027	%	100	EUR	1,000	1.000,35	0,00
4,2000 % Banque Centrale de Tunisie YN-Bonds 2001(31)	XS0126471233	%	500.000	JPY	41,514	1.316.600,46	0,46
3,5000 % Banque Centrale de Tunisie YN-Med.-Term Nts 2003(33)	XS0162198351	%	500.000	JPY	41,037	1.301.450,66	0,45
7,5000 % Alb.Cos LLC/Safe.Inc/N.A.I./A. DL-Notes 2019(19/26) 144A	US013092AA91	%	4.000	USD	101,495	3.721.500,76	1,29
7,6250 % HSBC Holdings PLC DL-Notes 2022(32)	US404280DK24	%	1.000	USD	104,443	957.403,41	0,33
8,2480 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-FLR Pref. MTN 22(32/33)Reg.S	XS2559133363	%	2.500	USD	104,723	2.399.924,95	0,83
4,6250 % Level 3 Financing Inc. DL-Notes 2019(19/27) 144A	US527298BN21	%	925	USD	68,486	580.708,04	0,20
1,4880 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 20(25/26) 144A	US83368RAZ55	%	3.500	USD	87,836	2.818.098,43	0,98
3,1270 % UniCredit S.p.A. DL-FLR Pref. MTN 2021(31/32)	US904678AY53	%	9.282	USD	79,101	6.730.383,30	2,33
6,8750 % Unisys Corp. DL-Notes 2020(20/27) 144A	US909214BV97	%	3.350	USD	71,259	2.188.274,42	0,76
Summe Wertpapiervermögen				EUR		243.696.532,22	84,48
Derivate				EUR		15.585.060,64	5,40

XAIA Credit Basis

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2023	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds				EUR		43.685.591,91	15,14
Bankguthaben				EUR		43.685.591,91	15,14
Guthaben bei Skandinaviska Enskilda Banken AB Stockholm Vorzeitig kündbares Termingeld							
			536,52	CHF		549,83	0,00
			108.609,00	JPY		688,89	0,00
Guthaben bei Bayerische Landesbank München Vorzeitig kündbares Termingeld							
			17.000.000,00	EUR		17.000.000,00	5,89
Guthaben bei HSBC Continental Europe S.A. - Paris Vorzeitig kündbares Termingeld							
			17.904.271,05	EUR		17.904.271,05	6,21
Guthaben bei Landesbank Baden-Württemberg Stuttgart Vorzeitig kündbares Termingeld							
			1.000.000,00	EUR		1.000.000,00	0,35
Guthaben bei SUMITOMO MITSUI TRUST BANK Ltd. GB Vorzeitig kündbares Termingeld							
			2.195,07	GBP		2.558,65	0,00
Guthaben bei Bank of Nova Scotia Kanada Vorzeitig kündbares Termingeld							
			8.484.500,37	USD		7.777.523,49	2,70
Sonstige Vermögensgegenstände				EUR		5.257.305,03	1,79
Zinsansprüche			3.437.077,97	EUR		3.437.077,97	1,16
Zinsansprüche Swaps			1.806.980,96	EUR		1.806.980,96	0,63
Sonstige Forderungen			13.246,10	EUR		13.246,10	0,00
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme				EUR		-18.126.098,67	-6,28
Kredite bei Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. EUR - Kredite							
			-50.462,86	EUR		-50.462,86	-0,02
EUR - Kredite (Cash Collateral)							
			-14.000.000,00	EUR		-14.000.000,00	-4,85
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen							
			-4.446.111,11	USD		-4.075.635,81	-1,41

XAIA Credit Basis

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2023	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
Verbindlichkeiten				EUR		-1.628.163,16	-0,53
Zinsverbindlichkeiten Swaps			-1.339.414,94	EUR		-1.339.414,94	-0,46
Verwaltungsvergütung			-139.358,53	EUR		-139.358,53	-0,05
Verwahrstellenvergütung			-7.556,79	EUR		-7.556,79	0,00
Depotgebühren			-26.725,19	EUR		-26.725,19	-0,01
Prüfungs- und Veröffentlichungskosten			-10.000,00	EUR		-10.000,00	0,00
Taxe d'abonnement			-7.214,13	EUR		-7.214,13	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten			-97.893,58	EUR		-97.893,58	-0,03
Fondsvermögen				EUR		288.470.227,97	100,00
XAIA Credit Basis (I)							
Anteilwert				EUR		1.096,44	
Ausgabepreis				EUR		1.096,44	
Rücknahmepreis				EUR		1.096,44	
Anteile im Umlauf				STK		189.130,069	
XAIA Credit Basis (G)							
Anteilwert				EUR		1.019,86	
Ausgabepreis				EUR		1.040,26	
Rücknahmepreis				EUR		1.019,86	
Anteile im Umlauf				STK		57,000	
XAIA Credit Basis (IT)							
Anteilwert				EUR		1.173,48	
Ausgabepreis				EUR		1.173,48	
Rücknahmepreis				EUR		1.173,48	
Anteile im Umlauf				STK		69.061,838	

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

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Devisentermingeschäfte zum 30.06.2023

	Währung 1	Betrag 1		Währung 2	Betrag 2	Fälligkeit	unreal. Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Verkauf	CHF	-750.000,00	Kauf	EUR	775.041,59	07.07.2023	6.143,55	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	GBP	-6.100.000,00	Kauf	EUR	7.084.702,85	07.07.2023	-23.601,83	J.P. Morgan SE Frankfurt
Verkauf	JPY	-849.100.000,00	Kauf	EUR	5.716.130,28	07.07.2023	326.535,15	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	JPY	-11.300.000,00	Kauf	EUR	73.032,22	07.07.2023	1.306,36	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Verkauf	USD	-159.000.000,00	Kauf	EUR	148.454.532,30	07.07.2023	2.750.331,99	J.P. Morgan SE Frankfurt
Verkauf	USD	-100.000,00	Kauf	EUR	92.569,64	07.07.2023	931,78	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Kauf	USD	200.000,00	Verkauf	EUR	-185.046,42	07.07.2023	-1.770,70	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	USD	-3.000.000,00	Kauf	EUR	2.739.343,27	07.07.2023	-9.792,58	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	USD	-4.000.000,00	Kauf	EUR	3.660.167,37	07.07.2023	-5.347,10	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	USD	-2.300.000,00	Kauf	EUR	2.089.172,61	07.07.2023	-18.498,21	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	USD	-5.000.000,00	Kauf	EUR	4.569.462,08	07.07.2023	-12.431,01	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt

Devisentermingeschäfte gesamt

3.013.807,40

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAP01006094	04.01.2030				
Floating Leg 04.01.10/04.01.30 USD 5,53035% (Floater)	1.200.000,00	USD	5,1927 variabel	-27.031,45	Deutsche Bank AG New York
Fixed Leg 04.01.10/04.01.30 USD 4,454% (Zinssatz fest)	-1.200.000,00	USD	4,4540 fix		
SWAPIRS030048917	08.04.2026				
Floating Leg 08.04.16/08.04.26 USD 5,54251% (Floater)	7.000.000,00	USD	5,2110 variabel	515.306,94	UniCredit Bank AG München
Fixed Leg 08.04.16/08.04.26 USD 1,61375% (Zinssatz fest)	-7.000.000,00	USD	1,6138 fix		
SWAPIRS030083205	13.04.2028				
Floating Leg 13.04.18/13.04.28 EUR 3,672% (Floater)	6.000.000,00	EUR	3,1080 variabel	619.637,56	Goldman Sachs International Limited London
Fixed Leg 13.04.18/13.04.28 EUR 0,8445% (Zinssatz fest)	-6.000.000,00	EUR	0,8445 fix		
SWAPIRS030088640	16.08.2023				
Floating Leg 16.08.18/16.08.23 GBP 4,36322% (Floater)	2.300.000,00	GBP	4,2279 variabel	10.865,40	Goldman Sachs International Limited London
Fixed Leg 16.08.18/16.08.23 GBP 1,3075% (Zinssatz fest)	-2.300.000,00	GBP	1,3075 fix		
SWAPIRS030092104	23.10.2028				
Floating Leg 23.10.18/23.10.28 JPY 0,04761% (Floater)	470.000.000,00	JPY	0,0476 variabel	-11.683,09	Goldman Sachs International Limited London
Fixed Leg 23.10.18/23.10.28 JPY 0,3775% (Zinssatz fest)	-470.000.000,00	JPY	0,3775 fix		
SWAPIRS107521	01.11.2025				
Floating Leg 01.11.19/01.11.25 EUR 3,725% (Floater)	4.000.000,00	EUR	3,2500 variabel	347.642,80	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 01.11.19/01.11.25 EUR -0,2535% (Zinssatz fest)	-4.000.000,00	EUR	-0,2535 fix		
SWAPIRS110555	24.01.2025				
Floating Leg 24.01.20/24.01.25 EUR 3,698% (Floater)	3.000.000,00	EUR	3,2110 variabel	184.290,79	J.P. Morgan SE Frankfurt
Fixed Leg 24.01.20/24.01.25 EUR -0,247% (Zinssatz fest)	-3.000.000,00	EUR	-0,2470 fix		
SWAPIRS110830	04.02.2030				
Floating Leg 04.02.20/04.02.30 USD 5,33629% (Floater)	2.000.000,00	USD	5,3363 variabel	263.674,61	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 04.02.20/04.02.30 USD 1,4795% (Zinssatz fest)	-2.000.000,00	USD	1,4795 fix		
SWAPIRS111915	10.03.2028				
Floating Leg 10.03.20/10.03.28 USD 5,53971% (Floater)	3.300.000,00	USD	5,5397 variabel	441.044,79	Deutsche Bank AG London
Fixed Leg 10.03.20/10.03.28 USD 0,771% (Zinssatz fest)	-3.300.000,00	USD	0,7710 fix		
SWAPIRS113038	24.03.2025				
Floating Leg 24.03.20/24.03.25 USD 5,54186% (Floater)	6.300.000,00	USD	5,5419 variabel	431.541,51	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 24.03.20/24.03.25 USD 0,6625% (Zinssatz fest)	-6.300.000,00	USD	0,6625 fix		
SWAPIRS114024	21.04.2028				
Floating Leg 21.04.20/21.04.28 EUR 3,646% (Floater)	750.000,00	EUR	3,2050 variabel	112.088,31	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 21.04.20/21.04.28 EUR -0,208% (Zinssatz fest)	-750.000,00	EUR	-0,2080 fix		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPIRS115261 Floating Leg 01.06.20/01.06.24 USD 5,496% (Floater) Fixed Leg 01.06.20/01.06.24 USD 0,328% (Zinssatz fest)	01.06.2024 15.000.000,00 -15.000.000,00	USD USD	5,4960 variabel 0,3280 fix	651.007,77	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPIRS115737 Floating Leg 16.06.20/16.06.27 USD 5,50843% (Floater) Fixed Leg 16.06.20/16.06.27 USD 0,5295% (Zinssatz fest)	16.06.2027 2.000.000,00 -2.000.000,00	USD USD	5,5084 variabel 0,5295 fix	253.594,76	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPIRS118372 Floating Leg 28.08.20/28.08.24 EUR 3,457% (Floater) Fixed Leg 28.08.20/28.08.24 EUR -0,442% (Zinssatz fest)	28.08.2024 4.700.000,00 -4.700.000,00	EUR EUR	3,4570 variabel -0,4420 fix	229.798,50	Deutsche Bank AG London
SWAPIRS118374 Floating Leg 28.08.20/28.08.25 EUR 3,457% (Floater) Fixed Leg 28.08.20/28.08.25 EUR -0,415% (Zinssatz fest)	28.08.2025 1.000.000,00 -1.000.000,00	EUR EUR	3,4570 variabel -0,4150 fix	84.616,01	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPIRS118378 Floating Leg 28.08.20/28.08.27 EUR 3,457% (Floater) Fixed Leg 28.08.20/28.08.27 EUR -0,337% (Zinssatz fest)	28.08.2027 4.200.000,00 -4.200.000,00	EUR EUR	3,4570 variabel -0,3370 fix	583.393,96	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPIRS118511 Floating Leg 02.09.20/02.09.23 USD 5,51671% (Floater) Fixed Leg 02.09.20/02.09.23 USD 0,24625% (Zinssatz fest)	02.09.2023 9.000.000,00 -9.000.000,00	USD USD	5,5167 variabel 0,2463 fix	79.664,16	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPIRS118513 Floating Leg 02.09.20/02.09.24 USD 5,51671% (Floater) Fixed Leg 02.09.20/02.09.24 USD 0,282% (Zinssatz fest)	02.09.2024 5.600.000,00 -5.600.000,00	USD USD	5,5167 variabel 0,2820 fix	303.086,47	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPIRS118516 Floating Leg 02.09.20/02.09.26 USD 5,51671% (Floater) Fixed Leg 02.09.20/02.09.26 USD 0,42% (Zinssatz fest)	02.09.2026 3.400.000,00 -3.400.000,00	USD USD	5,5167 variabel 0,4200 fix	380.358,87	Deutsche Bank AG London
SWAPIRS119826 Floating Leg 19.10.20/19.10.25 USD 5,58173% (Floater) Fixed Leg 19.10.20/19.10.25 USD 0,3725% (Zinssatz fest)	19.10.2025 11.000.000,00 -11.000.000,00	USD USD	5,2650 variabel 0,3725 fix	992.087,14	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPIRS122015 Floating Leg 28.01.21/28.01.26 USD 5,6272% (Floater) Fixed Leg 28.01.21/28.01.26 USD 0,515% (Zinssatz fest)	28.01.2026 6.000.000,00 -6.000.000,00	USD USD	5,2727 variabel 0,5150 fix	568.282,94	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPIRS122553 Floating Leg 24.02.21/24.02.25 USD 5,37471% (Floater) Fixed Leg 24.02.21/24.02.25 USD 0,5225% (Zinssatz fest)	24.02.2025 6.100.000,00 -6.100.000,00	USD USD	5,3747 variabel 0,5225 fix	414.982,47	Deutsche Bank AG Frankfurt

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPIRS127146 Floating Leg 10.06.21/10.06.25 EUR 3,486% (Floater) Fixed Leg 10.06.21/10.06.25 EUR -0,396% (Zinssatz fest)	10.06.2025 2.000.000,00 -2.000.000,00	EUR EUR	3,4860 variabel -0,3960 fix	153.998,15	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPIRS133641 Floating Leg 16.02.22/16.02.29 USD 4,89572% (Floater) Fixed Leg 16.02.22/16.02.29 USD 1,7019% (Zinssatz fest)	16.02.2029 2.400.000,00 -2.400.000,00	USD USD	4,8475 variabel 1,7019 fix	229.610,09	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPIRS140224 Floating Leg 17.06.22/17.06.29 EUR 3,547% (Floater) Fixed Leg 17.06.22/17.06.29 EUR 2,279% (Zinssatz fest)	17.06.2029 1.000.000,00 -1.000.000,00	EUR EUR	3,5470 variabel 2,2790 fix	44.207,33	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPIRS142253 Floating Leg 05.08.22/05.08.30 EUR 3,275% (Floater) Fixed Leg 05.08.22/05.08.30 EUR 1,58% (Zinssatz fest)	05.08.2030 1.000.000,00 -1.000.000,00	EUR EUR	3,2750 variabel 1,5800 fix	91.398,16	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPIRS142633 Floating Leg 16.08.22/16.08.24 EUR 3,348% (Floater) Fixed Leg 16.08.22/16.08.24 EUR 1,305% (Zinssatz fest)	16.08.2024 3.700.000,00 -3.700.000,00	EUR EUR	3,3480 variabel 1,3050 fix	106.126,82	Deutsche Bank AG London
SWAPIRS142665 Floating Leg 18.08.22/18.08.26 EUR 3,382% (Floater) Fixed Leg 18.08.22/18.08.26 EUR 1,398% (Zinssatz fest)	18.08.2026 1.800.000,00 -1.800.000,00	EUR EUR	3,3820 variabel 1,3980 fix	110.178,05	Deutsche Bank AG London
SWAPIRS144553 Floating Leg 27.09.22/27.09.26 GBP 3,74054% (Floater) Fixed Leg 27.09.22/27.09.26 GBP 5,084% (Zinssatz fest)	27.09.2026 1.500.000,00 -1.500.000,00	GBP GBP	3,6169 variabel 5,0840 fix	28.949,89	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPIRS146123 Floating Leg 28.10.22/28.10.27 EUR 3,714% (Floater) Fixed Leg 28.10.22/28.10.27 EUR 2,843% (Zinssatz fest)	28.10.2027 1.900.000,00 -1.900.000,00	EUR EUR	3,2420 variabel 2,8430 fix	33.321,62	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPIRS146918 Floating Leg 21.11.22/21.11.32 USD 4,65842% (Floater) Fixed Leg 21.11.22/21.11.32 USD 3,427% (Zinssatz fest)	21.11.2032 6.500.000,00 -6.500.000,00	USD USD	4,6010 variabel 3,4270 fix	52.026,25	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPIRS146921 Floating Leg 21.11.22/21.11.27 USD 4,65842% (Floater) Fixed Leg 21.11.22/21.11.27 USD 3,7095% (Zinssatz fest)	21.11.2027 5.000.000,00 -5.000.000,00	USD USD	4,6010 variabel 3,7095 fix	49.051,29	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPIRS147125 Floating Leg 23.11.22/23.11.28 EUR 3,415% (Floater) Fixed Leg 23.11.22/23.11.28 EUR 2,647% (Zinssatz fest)	23.11.2028 3.000.000,00 -3.000.000,00	EUR EUR	3,4150 variabel 2,6470 fix	74.717,15	Deutsche Bank AG Frankfurt

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPIRS147127 Floating Leg 23.11.22/23.11.31 USD 4,66526% (Floater) Fixed Leg 23.11.22/23.11.31 USD 3,509% (Zinssatz fest)	23.11.2031 2.700.000,00 -2.700.000,00	USD USD	4,6082 variabel 3,5090 fix	12.248,74	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPIRS147263 Floating Leg 30.11.22/30.11.32 USD 4,69012% (Floater) Fixed Leg 30.11.22/30.11.32 USD 3,379% (Zinssatz fest)	30.11.2032 1.200.000,00 -1.200.000,00	USD USD	4,6346 variabel 3,3790 fix	13.795,89	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPIRS147318 Floating Leg 05.12.22/05.12.28 USD 4,70845% (Floater) Fixed Leg 05.12.22/05.12.28 USD 3,411% (Zinssatz fest)	05.12.2028 4.200.000,00 -4.200.000,00	USD USD	4,6541 variabel 3,4110 fix	75.484,17	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPIRS148229 Floating Leg 21.12.22/21.12.30 USD 4,75978% (Floater) Fixed Leg 21.12.22/21.12.30 USD 3,28% (Zinssatz fest)	21.12.2030 1.000.000,00 -1.000.000,00	USD USD	4,7087 variabel 3,2800 fix	20.590,33	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPIRS148239 Floating Leg 21.12.22/21.12.28 USD 4,75978% (Floater) Fixed Leg 21.12.22/21.12.28 USD 3,361% (Zinssatz fest)	21.12.2028 3.000.000,00 -3.000.000,00	USD USD	4,7087 variabel 3,3610 fix	60.318,82	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPIRS148560 Floating Leg 13.01.23/13.01.31 USD 4,81225% (Floater) Fixed Leg 13.01.23/13.01.31 USD 3,274% (Zinssatz fest)	13.01.2031 3.000.000,00 -3.000.000,00	USD USD	4,7632 variabel 3,2740 fix	62.974,46	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPIRS148684 Floating Leg 20.01.23/20.01.28 USD 4,83073% (Floater) Fixed Leg 20.01.23/20.01.28 USD 3,2595% (Zinssatz fest)	20.01.2028 4.500.000,00 -4.500.000,00	USD USD	4,7828 variabel 3,2595 fix	117.180,81	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPIRS148686 Floating Leg 20.01.23/20.01.33 USD 4,83073% (Floater) Fixed Leg 20.01.23/20.01.33 USD 3,128% (Zinssatz fest)	20.01.2033 4.000.000,00 -4.000.000,00	USD USD	4,7828 variabel 3,1280 fix	118.717,08	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPIRS148839 Floating Leg 01.02.23/01.02.33 USD 4,8658% (Floater) Fixed Leg 01.02.23/01.02.33 USD 3,2415% (Zinssatz fest)	01.02.2033 1.500.000,00 -1.500.000,00	USD USD	4,8208 variabel 3,2415 fix	32.027,67	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPIRS149169 Floating Leg 09.02.23/09.02.29 USD 4,88173% (Floater) Fixed Leg 09.02.23/09.02.29 USD 3,499% (Zinssatz fest)	09.02.2029 1.300.000,00 -1.300.000,00	USD USD	4,8374 variabel 3,4990 fix	17.572,31	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPIRS152259 Floating Leg 17.04.23/17.04.27 USD 5,02783% (Floater) Fixed Leg 17.04.23/17.04.27 USD 3,379% (Zinssatz fest)	17.04.2027 3.500.000,00 -3.500.000,00	USD USD	5,0000 variabel 3,3790 fix	80.688,08	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPIRS152261 Floating Leg 17.04.23/17.04.29 USD 5,02783% (Floater) Fixed Leg 17.04.23/17.04.29 USD 3,2% (Zinssatz fest)	17.04.2029 1.000.000,00 -1.000.000,00	USD USD	5,0000 variabel 3,2000 fix	26.870,01	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPIRS152262 Floating Leg 17.04.23/17.04.33 USD 5,02783% (Floater) Fixed Leg 17.04.23/17.04.33 USD 3,13% (Zinssatz fest)	17.04.2033 1.600.000,00 -1.600.000,00	USD USD	5,0000 variabel 3,1300 fix	47.099,02	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPIRS152265 Floating Leg 17.04.23/17.04.28 EUR 3,663% (Floater) Fixed Leg 17.04.23/17.04.28 EUR 3,022% (Zinssatz fest)	17.04.2028 2.300.000,00 -2.300.000,00	EUR EUR	3,1770 variabel 3,0220 fix	19.993,30	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPIRS153015 Floating Leg 19.05.23/19.05.32 USD 5,07365% (Floater) Fixed Leg 19.05.23/19.05.32 USD 3,227% (Zinssatz fest)	19.05.2032 2.500.000,00 -2.500.000,00	USD USD	5,0556 variabel 3,2270 fix	56.465,47	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPIRS153105 Floating Leg 24.05.23/24.05.33 USD 5,07536% (Floater) Fixed Leg 24.05.23/24.05.33 USD 3,424% (Zinssatz fest)	24.05.2033 1.700.000,00 -1.700.000,00	USD USD	5,0563 variabel 3,4240 fix	12.329,86	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPIRS153109 Floating Leg 25.05.23/25.05.27 USD 5,07574% (Floater) Fixed Leg 25.05.23/25.05.27 USD 3,686% (Zinssatz fest)	25.05.2027 4.300.000,00 -4.300.000,00	USD USD	5,0564 variabel 3,6860 fix	55.000,26	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPIRS153110 Floating Leg 25.05.23/25.05.30 USD 5,07574% (Floater) Fixed Leg 25.05.23/25.05.30 USD 3,4825% (Zinssatz fest)	25.05.2030 3.700.000,00 -3.700.000,00	USD USD	5,0564 variabel 3,4825 fix	36.840,43	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPIRS153336 Floating Leg 07.06.23/07.06.28 USD (Floater) Fixed Leg 07.06.23/07.06.28 USD 3,7075% (Zinssatz fest)	07.06.2028 8.200.000,00 -8.200.000,00	USD USD	0,0000 variabel 3,7075 fix	56.323,61	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPIRS153430 Floating Leg 15.06.23/15.06.28 USD (Floater) Fixed Leg 15.06.23/15.06.28 USD 3,6585% (Zinssatz fest)	15.06.2028 3.500.000,00 -3.500.000,00	USD USD	0,0000 variabel 3,6585 fix	30.492,85	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPIRS153432 Floating Leg 15.06.23/15.06.33 USD (Floater) Fixed Leg 15.06.23/15.06.33 USD 3,454% (Zinssatz fest)	15.06.2033 1.100.000,00 -1.100.000,00	USD USD	0,0000 variabel 3,4540 fix	5.291,27	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPIRS153434 Floating Leg 15.06.23/15.06.28 EUR 3,526% (Floater) Fixed Leg 15.06.23/15.06.28 EUR 3,02% (Zinssatz fest)	15.06.2028 2.000.000,00 -2.000.000,00	EUR EUR	3,5260 variabel 3,0200 fix	16.002,10	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPIRS153444	16.06.2029				
Floating Leg 16.06.23/16.06.29 USD (Floater)	4.500.000,00	USD	0,0000 variabel	17.273,98	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 16.06.23/16.06.29 USD 3,667% (Zinssatz fest)	-4.500.000,00	USD	3,6670 fix		
SWAPIRS153492	20.06.2033				
Floating Leg 20.06.23/20.06.33 USD (Floater)	2.250.000,00	USD	0,0000 variabel	-6.674,22	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 20.06.23/20.06.33 USD 3,555% (Zinssatz fest)	-2.250.000,00	USD	3,5550 fix		
SWAPIRS153495	20.06.2027				
Floating Leg 20.06.23/20.06.27 USD (Floater)	2.000.000,00	USD	0,0000 variabel	12.557,13	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 20.06.23/20.06.27 USD 3,8625% (Zinssatz fest)	-2.000.000,00	USD	3,8625 fix		
SWAPIRS153540	22.06.2028				
Floating Leg 22.06.23/22.06.28 USD (Floater)	3.000.000,00	USD	0,0000 variabel	16.971,38	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 22.06.23/22.06.28 USD 3,73% (Zinssatz fest)	-3.000.000,00	USD	3,7300 fix		
SWAPIRS153541	22.06.2033				
Floating Leg 22.06.23/22.06.33 USD (Floater)	1.750.000,00	USD	0,0000 variabel	7.741,93	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 22.06.23/22.06.33 USD 3,4583% (Zinssatz fest)	-1.750.000,00	USD	3,4583 fix		
SWAPIRS153562	23.06.2026				
Floating Leg 23.06.23/23.06.26 USD (Floater)	2.500.000,00	USD	0,0000 variabel	7.726,60	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 23.06.23/23.06.26 USD 4,2132% (Zinssatz fest)	-2.500.000,00	USD	4,2132 fix		
SWAPIRS153653	28.06.2026				
Floating Leg 28.06.23/28.06.26 USD (Floater)	5.100.000,00	USD	0,0000 variabel	22.349,87	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 28.06.23/28.06.26 USD 3,555% (Zinssatz fest)	-5.100.000,00	USD	3,5550 fix		
Zinsswaps gesamt				9.454.089,23	
Credit Default Swaps					
SWAPCDS030021927	20.12.2023				
CDS Reference Asset 20.03.14/20.12.23 EUR Commerzbank AG LT2 Nachr.MTN S.773 v.2011(19)	900.000,00	EUR		-17.870,79	Goldman Sachs International Limited London
CDS Gebührenleg 20.03.14/20.12.23 EUR 5%	-900.000,00	EUR	5,0000		
SWAPCDS030021943	20.12.2023				
CDS Reference Asset 20.06.19/20.12.23 EUR Commerzbank AG LT2 Nachr.MTN S.773 v.2011(19)	620.000,00	EUR		-12.310,99	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Gebührenleg 20.06.19/20.12.23 EUR 5%	-620.000,00	EUR	5,0000		
SWAPCDS030079605	20.12.2027				
CDS Reference Asset 20.06.19/20.12.27 USD Banque Centrale de Tunisie DL-Notes 1997(27)	4.000.000,00	USD		1.008.341,74	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Gebührenleg 20.06.19/20.12.27 USD 1%	-4.000.000,00	USD	1,0000		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS030079850	20.12.2027				
CDS Reference Asset 20.06.19/20.12.27 USD Banque Centrale de Tunisie DL-Notes 1997(27)	5.000.000,00	USD		1.260.427,17	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Gebührenleg 20.06.19/20.12.27 USD 1%	-5.000.000,00	USD	1,0000		
SWAPCDS030085309	20.06.2028				
CDS Reference Asset 20.06.19/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	154.000.000,00	JPY		68.864,69	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Gebührenleg 20.06.19/20.06.28 JPY 1%	-154.000.000,00	JPY	1,0000		
SWAPCDS030086904	20.06.2028				
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	125.000.000,00	JPY		55.896,67	Goldman Sachs International Limited London
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-125.000.000,00	JPY	1,0000		
SWAPCDS030087005	20.06.2028				
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	125.000.000,00	JPY		55.896,67	Goldman Sachs International Limited London
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-125.000.000,00	JPY	1,0000		
SWAPCDS030087009	20.06.2028				
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	62.500.000,00	JPY		27.948,33	Goldman Sachs International Limited London
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-62.500.000,00	JPY	1,0000		
SWAPCDS030087305	20.06.2028				
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	156.250.000,00	JPY		69.870,83	Goldman Sachs International Limited London
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-156.250.000,00	JPY	1,0000		
SWAPCDS030087306	20.06.2028				
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	125.000.000,00	JPY		55.896,67	Goldman Sachs International Limited London
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-125.000.000,00	JPY	1,0000		
SWAPCDS030087406	20.06.2028				
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	131.600.000,00	JPY		58.848,01	Goldman Sachs International Limited London
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-131.600.000,00	JPY	1,0000		
SWAPCDS030087809	20.06.2028				
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	170.300.000,00	JPY		76.153,62	Goldman Sachs International Limited London
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-170.300.000,00	JPY	1,0000		
SWAPCDS030087810	20.06.2028				
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	100.000.000,00	JPY		44.717,33	Goldman Sachs International Limited London
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-100.000.000,00	JPY	1,0000		
SWAPCDS030087828	20.06.2028				
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	104.800.000,00	JPY		46.863,77	Goldman Sachs International Limited London
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-104.800.000,00	JPY	1,0000		

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS030088625 CDS Reference Asset 20.06.19/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44 CDS Gebührenleg 20.06.19/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 127.500.000,00 -127.500.000,00	JPY JPY	1,0000	57.014,60	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS107142 CDS Reference Asset 20.09.19/20.06.26 USD Boyd Gaming Corp. DL-Notes 2015(15/23) CDS Gebührenleg 20.09.19/20.06.26 USD 5%	20.06.2026 1.350.000,00 -1.350.000,00	USD USD	5,0000	-148.180,24	Credit Suisse International London
SWAPCDS108037 CDS Reference Asset 20.09.19/20.06.26 USD Boyd Gaming Corp. DL-Notes 2015(15/23) CDS Gebührenleg 20.09.19/20.06.26 USD 5%	20.06.2026 450.000,00 -450.000,00	USD USD	5,0000	-49.393,41	Credit Suisse International London
SWAPCDS108302 CDS Reference Asset 20.09.19/20.12.24 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 20.09.19/20.12.24 USD 1%	20.12.2024 3.000.000,00 -3.000.000,00	USD USD	1,0000	-16.362,41	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS110804 CDS Reference Asset 20.12.19/20.12.24 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 20.12.19/20.12.24 USD 1%	20.12.2024 1.700.000,00 -1.700.000,00	USD USD	1,0000	-9.272,03	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS110847 CDS Reference Asset 20.12.19/20.12.24 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 20.12.19/20.12.24 USD 1%	20.12.2024 2.500.000,00 -2.500.000,00	USD USD	1,0000	-13.635,34	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS114084 CDS Reference Asset 20.03.20/20.12.24 USD Howmet Aerospace Inc. DL-Notes 2014(14/24) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.12.24 USD 5%	20.12.2024 2.700.000,00 -2.700.000,00	USD USD	5,0000	-166.926,08	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS114403 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Level 3 Financing Inc. DL-Notes 2015(15/22) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 850.000,00 -850.000,00	USD USD	5,0000	-68.056,91	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS114413 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Transdigm Inc. DL-Notes 2014(14/24) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 1.000.000,00 -1.000.000,00	USD USD	5,0000	-71.121,97	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS114499 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Avient Corp. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 1.800.000,00 -1.800.000,00	USD USD	5,0000	-132.934,21	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS114760 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Avient Corp. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 675.000,00 -675.000,00	USD USD	5,0000	-49.850,33	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS115041 CDS Reference Asset 20.03.20/20.03.25 USD Radian Group Inc. DL-Notes 2017(17/24) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.03.25 USD 5%	20.03.2025 970.000,00 -970.000,00	USD USD	5,0000	-61.862,97	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS115058 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Aramark Services Inc. DL-Notes 2017(17/26) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 1.425.000,00 -1.425.000,00	USD USD	5,0000	-105.951,17	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS115078 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Aramark Services Inc. DL-Notes 2017(17/26) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 500.000,00 -500.000,00	USD USD	5,0000	-37.175,85	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS116935 CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Ovintiv Inc. DL-Notes 2015(15/26) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 1%	20.03.2026 2.200.000,00 -2.200.000,00	USD USD	1,0000	-27.932,85	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS116953 CDS Reference Asset 22.06.20/20.06.25 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44 CDS Gebührenleg 22.06.20/20.06.25 JPY 1%	20.06.2025 454.250.000,00 -454.250.000,00	JPY JPY	1,0000	28.812,46	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS116954 CDS Reference Asset 22.06.20/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44 CDS Gebührenleg 22.06.20/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 525.700.000,00 -525.700.000,00	JPY JPY	1,0000	235.079,02	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS117105 CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Ovintiv Inc. DL-Notes 2015(15/26) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 1%	20.03.2026 1.100.000,00 -1.100.000,00	USD USD	1,0000	-13.966,42	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS117322 CDS Reference Asset 22.06.20/20.06.25 USD Expedia Group Inc. DL-Notes 2014(14/24) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.06.25 USD 1%	20.06.2025 1.100.000,00 -1.100.000,00	USD USD	1,0000	-11.736,18	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS118126 CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Ovintiv Inc. DL-Notes 2015(15/26) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	20.03.2026 1.150.000,00 -1.150.000,00	USD USD	5,0000	-121.836,26	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS118141 CDS Reference Asset 22.06.20/20.09.23 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.09.23 USD 5%	20.09.2023 800.000,00 -800.000,00	USD USD	5,0000	-7.872,09	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS118335 CDS Reference Asset 22.06.20/20.09.23 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.09.23 USD 5%	20.09.2023 1.700.000,00 -1.700.000,00	USD USD	5,0000	-16.728,20	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS118350 CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	20.03.2026 950.000,00 -950.000,00	USD USD	5,0000	-101.064,66	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS118351 CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	20.03.2026 950.000,00 -950.000,00	USD USD	5,0000	-101.064,66	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS118644 CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	20.03.2026 950.000,00 -950.000,00	USD USD	5,0000	-101.064,66	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS118645 CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	20.03.2026 950.000,00 -950.000,00	USD USD	5,0000	-101.064,66	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS118818 CDS Reference Asset 22.06.20/20.06.25 USD Expedia Group Inc. DL-Notes 2014(14/24) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.06.25 USD 1%	20.06.2025 1.200.000,00 -1.200.000,00	USD USD	1,0000	-12.803,11	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS119427 CDS Reference Asset 21.09.20/20.03.26 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22) CDS Gebührenleg 21.09.20/20.03.26 USD 5%	20.03.2026 5.000.000,00 -5.000.000,00	USD USD	5,0000	-497.820,96	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS119724 CDS Reference Asset 21.09.20/20.06.25 USD Avient Corp. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 21.09.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 1.350.000,00 -1.350.000,00	USD USD	5,0000	-99.700,66	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS119726 CDS Reference Asset 21.09.20/20.03.26 USD Ovintiv Inc. DL-Notes 2015(15/26) CDS Gebührenleg 21.09.20/20.03.26 USD 1%	20.03.2026 2.100.000,00 -2.100.000,00	USD USD	1,0000	-26.663,17	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
SWAPCDS119734 CDS Reference Asset 21.09.20/20.06.25 USD Avient Corp. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 21.09.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 720.000,00 -720.000,00	USD USD	5,0000	-53.173,68	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS119754 CDS Reference Asset 21.09.20/20.06.25 USD Avient Corp. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 21.09.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 675.000,00 -675.000,00	USD USD	5,0000	-49.850,33	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS120907 CDS Reference Asset 21.09.20/20.12.25 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 21.09.20/20.12.25 USD 1%	20.12.2025 550.000,00 -550.000,00	USD USD	1,0000	5.225,65	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS120908 CDS Reference Asset 21.09.20/20.09.23 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22) CDS Gebührenleg 21.09.20/20.09.23 USD 5%	20.09.2023 125.000,00 -125.000,00	USD USD	5,0000	-1.230,01	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS120910 CDS Reference Asset 21.09.20/20.03.26 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22) CDS Gebührenleg 21.09.20/20.03.26 USD 5%	20.03.2026 250.000,00 -250.000,00	USD USD	5,0000	-24.891,05	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS120930 CDS Reference Asset 21.09.20/20.12.25 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 21.09.20/20.12.25 USD 1%	20.12.2025 1.100.000,00 -1.100.000,00	USD USD	1,0000	10.451,30	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS121535 CDS Reference Asset 21.12.20/20.09.23 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.09.23 USD 5%	20.09.2023 5.500.000,00 -5.500.000,00	USD USD	5,0000	-54.120,65	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS121554 CDS Reference Asset 21.12.20/20.09.23 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.09.23 USD 5%	20.09.2023 1.500.000,00 -1.500.000,00	USD USD	5,0000	-14.760,18	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS123121 CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.23 USD 5% CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.23 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29)	20.12.2023 126.000,00 -126.000,00	USD USD	5,0000	-16.172,16	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123122 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.25 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.25 USD 5%	20.12.2025 216.000,00 -216.000,00	USD USD	5,0000	109.173,40	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123123 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.26 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.26 USD 5%	20.12.2026 198.000,00 -198.000,00	USD USD	5,0000	113.309,33	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123124 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.27 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.27 USD 5%	20.12.2027 234.000,00 -234.000,00	USD USD	5,0000	139.187,99	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123125 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.28 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.28 USD 5%	20.12.2028 252.000,00 -252.000,00	USD USD	5,0000	152.558,56	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123126 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.29 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.29 USD 5%	20.12.2029 288.000,00 -288.000,00	USD USD	5,0000	177.967,69	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS123127 CDS Reference Asset 21.12.20/20.09.30 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.09.30 USD 5%	20.09.2030 144.000,00 -144.000,00	USD USD	5,0000	89.826,47	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123549 CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.23 USD 5% CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.23 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29)	20.12.2023 48.000,00 -48.000,00	USD USD	5,0000	-6.160,82	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123550 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.25 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.25 USD 5%	20.12.2025 144.000,00 -144.000,00	USD USD	5,0000	72.782,27	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123551 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.26 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.26 USD 5%	20.12.2026 132.000,00 -132.000,00	USD USD	5,0000	75.539,55	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123552 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.27 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.27 USD 5%	20.12.2027 156.000,00 -156.000,00	USD USD	5,0000	92.791,99	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123553 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.28 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.28 USD 5%	20.12.2028 168.000,00 -168.000,00	USD USD	5,0000	101.705,70	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123554 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.29 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.29 USD 5%	20.12.2029 192.000,00 -192.000,00	USD USD	5,0000	118.645,13	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123555 CDS Reference Asset 21.12.20/20.09.30 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.09.30 USD 5%	20.09.2030 96.000,00 -96.000,00	USD USD	5,0000	59.884,31	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123571 CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.23 USD 5% CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.23 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29)	20.12.2023 48.000,00 -48.000,00	USD USD	5,0000	-6.160,82	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123572 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.25 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.25 USD 5%	20.12.2025 144.000,00 -144.000,00	USD USD	5,0000	72.782,27	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123573 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.26 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.26 USD 5%	20.12.2026 132.000,00 -132.000,00	USD USD	5,0000	75.539,55	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS123574 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.27 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.27 USD 5%	20.12.2027 144.000,00 -144.000,00	USD USD	5,0000	85.654,15	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123575 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.28 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.28 USD 5%	20.12.2028 168.000,00 -168.000,00	USD USD	5,0000	101.705,70	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123576 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.29 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.29 USD 5%	20.12.2029 192.000,00 -192.000,00	USD USD	5,0000	118.645,13	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123577 CDS Reference Asset 21.12.20/20.09.30 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.09.30 USD 5%	20.09.2030 96.000,00 -96.000,00	USD USD	5,0000	59.884,31	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS126817 CDS Reference Asset 22.03.21/20.06.25 USD Transdigm Inc. DL-Notes 2017(17/26) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 1.050.000,00 -1.050.000,00	USD USD	5,0000	-74.678,07	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS127164 CDS Reference Asset 22.03.21/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.03.26 USD 1%	20.03.2026 2.450.000,00 -2.450.000,00	USD USD	1,0000	137.048,69	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS127311 CDS Reference Asset 22.03.21/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.03.26 USD 1%	20.03.2026 970.000,00 -970.000,00	USD USD	1,0000	54.260,09	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS127431 CDS Gebührenleg 22.03.21/20.06.24 USD 5% CDS Reference Asset 22.03.21/20.06.24 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29)	20.06.2024 36.000,00 -36.000,00	USD USD	5,0000	-6.930,64	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS127432 CDS Reference Asset 22.03.21/20.06.25 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 84.000,00 -84.000,00	USD USD	5,0000	37.731,66	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS127433 CDS Reference Asset 22.03.21/20.06.26 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.06.26 USD 5%	20.06.2026 132.000,00 -132.000,00	USD USD	5,0000	72.602,72	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS127434 CDS Reference Asset 22.03.21/20.06.27 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.06.27 USD 5%	20.06.2027 144.000,00 -144.000,00	USD USD	5,0000	85.143,02	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS127435 CDS Reference Asset 22.03.21/20.06.28 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.06.28 USD 5%	20.06.2028 156.000,00 -156.000,00	USD USD	5,0000	93.310,78	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS127436 CDS Reference Asset 22.03.21/20.06.29 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.06.29 USD 5%	20.06.2029 180.000,00 -180.000,00	USD USD	5,0000	110.150,50	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS127437 CDS Reference Asset 22.03.21/20.09.30 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.09.30 USD 5%	20.09.2030 192.000,00 -192.000,00	USD USD	5,0000	119.768,62	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS128123 CDS Reference Asset 21.06.21/20.06.26 USD MGIC Investment Corp. DL-Notes 2016(16/23) CDS Gebührenleg 21.06.21/20.06.26 USD 5%	20.06.2026 1.700.000,00 -1.700.000,00	USD USD	5,0000	-185.860,89	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS128904 CDS Reference Asset 21.06.21/20.03.27 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) CDS Gebührenleg 21.06.21/20.03.27 JPY 1%	20.03.2027 143.000.000,00 -143.000.000,00	JPY JPY	1,0000	35.782,45	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS130703 CDS Reference Asset 20.09.21/20.12.26 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A CDS Gebührenleg 20.09.21/20.12.26 USD 5%	20.12.2026 950.000,00 -950.000,00	USD USD	5,0000	-104.183,06	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS130722 CDS Reference Asset 20.09.21/20.12.26 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A CDS Gebührenleg 20.09.21/20.12.26 USD 5%	20.12.2026 430.000,00 -430.000,00	USD USD	5,0000	-47.156,54	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS131203 CDS Reference Asset 20.09.21/20.03.24 EUR Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.21/20.03.24 EUR 5%	20.03.2024 300.000,00 -300.000,00	EUR EUR	5,0000	-8.517,37	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid
SWAPCDS131823 CDS Reference Asset 20.09.21/20.12.26 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) CDS Gebührenleg 20.09.21/20.12.26 JPY 1%	20.12.2026 67.500.000,00 -67.500.000,00	JPY JPY	1,0000	14.532,15	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS131824 CDS Reference Asset 20.09.21/20.03.24 EUR Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.21/20.03.24 EUR 5%	20.03.2024 600.000,00 -600.000,00	EUR EUR	5,0000	-17.034,74	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid
SWAPCDS132071 CDS Reference Asset 20.09.21/20.03.24 EUR Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.21/20.03.24 EUR 5%	20.03.2024 360.000,00 -360.000,00	EUR EUR	5,0000	-10.220,85	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS132087 CDS Reference Asset 20.09.21/20.03.24 EUR Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.21/20.03.24 EUR 5%	20.03.2024 490.000,00 -490.000,00	EUR EUR	5,0000	-13.911,71	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid
SWAPCDS132244 CDS Reference Asset 20.09.21/20.09.23 EUR Ladbrokes Group Finance PLC LS-Notes 2014(22) CDS Gebührenleg 20.09.21/20.09.23 EUR 1%	20.09.2023 540.000,00 -540.000,00	EUR EUR	1,0000	-974,40	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS132245 CDS Reference Asset 20.09.21/20.09.23 EUR Ladbrokes Group Finance PLC LS-Notes 2014(22) CDS Gebührenleg 20.09.21/20.09.23 EUR 1%	20.09.2023 1.080.000,00 -1.080.000,00	EUR EUR	1,0000	-1.948,80	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid
SWAPCDS132246 CDS Reference Asset 20.09.21/20.09.23 EUR Ladbrokes Group Finance PLC LS-Notes 2014(22) CDS Gebührenleg 20.09.21/20.09.23 EUR 1%	20.09.2023 260.000,00 -260.000,00	EUR EUR	1,0000	-469,16	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid
SWAPCDS133213 CDS Reference Asset 20.12.21/20.12.26 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) CDS Gebührenleg 20.12.21/20.12.26 JPY 1%	20.12.2026 85.000.000,00 -85.000.000,00	JPY JPY	1,0000	18.299,75	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS133331 CDS Reference Asset 20.12.21/20.03.24 EUR Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S CDS Gebührenleg 20.12.21/20.03.24 EUR 5%	20.03.2024 1.500.000,00 -1.500.000,00	EUR EUR	5,0000	-42.586,86	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS134283 CDS Reference Asset 20.12.21/20.09.23 EUR Ladbrokes Group Finance PLC LS-Notes 2014(22) CDS Gebührenleg 20.12.21/20.09.23 EUR 1%	20.09.2023 1.500.000,00 -1.500.000,00	EUR EUR	1,0000	-2.706,67	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid
SWAPCDS135093 CDS Reference Asset 21.03.22/20.06.27 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2018(18/28) CDS Gebührenleg 21.03.22/20.06.27 USD 1%	20.06.2027 1.800.000,00 -1.800.000,00	USD USD	1,0000	86.631,76	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS135206 CDS Reference Asset 21.03.22/20.06.24 USD Avient Corp. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 21.03.22/20.06.24 USD 5%	20.06.2024 500.000,00 -500.000,00	USD USD	5,0000	-20.539,97	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS135207 CDS Reference Asset 21.03.22/20.09.25 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26) CDS Gebührenleg 21.03.22/20.09.25 USD 1%	20.09.2025 980.000,00 -980.000,00	USD USD	1,0000	-3.919,02	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS136141 CDS Reference Asset 21.03.22/20.06.25 USD Aramark Services Inc. DL-Notes 2020(20/25) 144A CDS Gebührenleg 21.03.22/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 600.000,00 -600.000,00	USD USD	5,0000	-44.611,02	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS136158 CDS Reference Asset 21.03.22/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28) CDS Gebührenleg 21.03.22/20.03.26 USD 1%	20.03.2026 1.650.000,00 -1.650.000,00	USD USD	1,0000	92.298,10	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS136173 CDS Reference Asset 21.03.22/20.06.27 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26) CDS Gebührenleg 21.03.22/20.06.27 USD 1%	20.06.2027 1.000.000,00 -1.000.000,00	USD USD	1,0000	43.545,38	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid
SWAPCDS136591 CDS Reference Asset 21.03.22/20.06.27 EUR Verisure Midholding AB EO-Notes 2021(21/29) Reg.S CDS Gebührenleg 21.03.22/20.06.27 EUR 5%	20.06.2027 1.500.000,00 -1.500.000,00	EUR EUR	5,0000	-45.832,86	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS136627 CDS Reference Asset 21.03.22/20.06.27 EUR Verisure Midholding AB EO-Notes 2021(21/29) Reg.S CDS Gebührenleg 21.03.22/20.06.27 EUR 5%	20.06.2027 1.000.000,00 -1.000.000,00	EUR EUR	5,0000	-30.555,24	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS136740 CDS Reference Asset 21.03.22/20.06.25 USD Avient Corp. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 21.03.22/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 1.540.000,00 -1.540.000,00	USD USD	5,0000	-113.732,60	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS138056 CDS Reference Asset 21.03.22/20.06.27 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26) CDS Gebührenleg 21.03.22/20.06.27 USD 1%	20.06.2027 1.160.000,00 -1.160.000,00	USD USD	1,0000	50.512,65	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS138124 CDS Reference Asset 21.03.22/20.09.23 EUR Ladbrokes Group Finance PLC LS-Notes 2016(16/23) CDS Gebührenleg 21.03.22/20.09.23 EUR 1%	20.09.2023 1.210.000,00 -1.210.000,00	EUR EUR	1,0000	-2.183,38	Societe Generale SA, Paris
SWAPCDS138125 CDS Reference Asset 21.03.22/20.09.23 EUR Ladbrokes Group Finance PLC LS-Notes 2016(16/23) CDS Gebührenleg 21.03.22/20.09.23 EUR 1%	20.09.2023 1.210.000,00 -1.210.000,00	EUR EUR	1,0000	-2.183,38	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS138439 CDS Reference Asset 21.03.22/20.06.27 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26) CDS Gebührenleg 21.03.22/20.06.27 USD 1%	20.06.2027 500.000,00 -500.000,00	USD USD	1,0000	21.772,69	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS139736 CDS Reference Asset 21.03.22/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28) CDS Gebührenleg 21.03.22/20.03.26 USD 1%	20.03.2026 1.500.000,00 -1.500.000,00	USD USD	1,0000	83.907,36	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS140209 CDS Reference Asset 20.06.22/20.03.25 EUR Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S CDS Gebührenleg 20.06.22/20.03.25 EUR 5%	20.03.2025 850.000,00 -850.000,00	EUR EUR	5,0000	-39.540,47	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS140334 CDS Reference Asset 21.06.22/20.03.25 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26) CDS Gebührenleg 21.06.22/20.03.25 USD 1%	20.03.2025 1.390.000,00 -1.390.000,00	USD USD	1,0000	-13.798,21	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS140657 CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.25 USD Aramark Services Inc. DL-Notes 2020(20/25) 144A CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 1.000.000,00 -1.000.000,00	USD USD	5,0000	-74.351,70	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS140782 CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.25 USD Aramark Services Inc. DL-Notes 2020(20/25) 144A CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 570.000,00 -570.000,00	USD USD	5,0000	-42.380,47	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS142218 CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.27 USD Netflix Inc. DL-Notes 2019(19/30) 144A CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.27 USD 5%	20.06.2027 1.000.000,00 -1.000.000,00	USD USD	5,0000	-142.554,94	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS142508 CDS Reference Asset 21.06.22/20.03.25 USD Radian Group Inc. DL-Notes 2017(17/24) CDS Gebührenleg 21.06.22/20.03.25 USD 5%	20.03.2025 1.270.000,00 -1.270.000,00	USD USD	5,0000	-80.995,85	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS142702 CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.26 USD Amkor Technology Inc. DL-Notes 2019(19/27) 144A CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.26 USD 5%	20.06.2026 585.000,00 -585.000,00	USD USD	5,0000	-60.992,90	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS143109 CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.26 USD Amkor Technology Inc. DL-Notes 2019(19/27) 144A CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.26 USD 5%	20.06.2026 975.000,00 -975.000,00	USD USD	5,0000	-101.654,84	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS143162 CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.27 USD MGIC Investment Corp. DL-Notes 2020(20/28) CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.27 USD 5%	20.06.2027 1.330.000,00 -1.330.000,00	USD USD	5,0000	-176.078,06	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS143171 CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.27 USD MGIC Investment Corp. DL-Notes 2020(20/28) CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.27 USD 5%	20.06.2027 790.000,00 -790.000,00	USD USD	5,0000	-104.587,72	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS143419 CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.27 USD Unisys Corp. DL-Notes 2020(20/27) 144A CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.27 USD 5%	20.06.2027 2.050.000,00 -2.050.000,00	USD USD	5,0000	230.233,59	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS143555 CDS Reference Asset 21.06.22/20.09.26 EUR B.A.T. Intl Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2012(23) CDS Gebührenleg 21.06.22/20.09.26 EUR 1%	20.09.2026 2.200.000,00 -2.200.000,00	EUR EUR	1,0000	-22.967,91	Deutsche Bank AG Frankfurt

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS143621 CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.27 USD Unisys Corp. DL-Notes 2020(20/27) 144A CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.27 USD 5%	20.06.2027 1.000.000,00 -1.000.000,00	USD USD	5,0000	112.309,07	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS145377 CDS Reference Asset 20.09.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 2.820.000,00 -2.820.000,00	EUR EUR	1,0000	-23.263,34	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS145403 CDS Reference Asset 20.09.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 1.410.000,00 -1.410.000,00	EUR EUR	1,0000	-11.631,67	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS145427 CDS Reference Asset 20.09.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 1.880.000,00 -1.880.000,00	EUR EUR	1,0000	-15.508,89	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS145515 CDS Reference Asset 20.09.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 1.860.000,00 -1.860.000,00	EUR EUR	1,0000	-15.343,90	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS145532 CDS Reference Asset 20.09.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 920.000,00 -920.000,00	EUR EUR	1,0000	-7.589,46	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS145533 CDS Reference Asset 20.09.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 750.000,00 -750.000,00	EUR EUR	1,0000	-6.187,06	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS145579 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.24 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.24 EUR 1%	20.06.2024 560.000,00 -560.000,00	EUR EUR	1,0000	-2.518,63	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146071 CDS Reference Asset 20.09.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 1.880.000,00 -1.880.000,00	EUR EUR	1,0000	-15.508,89	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS146108 CDS Reference Asset 20.09.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 940.000,00 -940.000,00	EUR EUR	1,0000	-7.754,45	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS146109 CDS Reference Asset 20.09.22/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.09.25 EUR 5%	20.09.2025 950.000,00 -950.000,00	EUR EUR	5,0000	6.184,06	J.P. Morgan SE Frankfurt

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS146110 CDS Reference Asset 20.09.22/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.09.25 EUR 5%	20.09.2025 950.000,00 -950.000,00	EUR EUR	5,0000	6.184,06	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS146162 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.24 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.24 EUR 1%	20.06.2024 1.000.000,00 -1.000.000,00	EUR EUR	1,0000	-4.497,55	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS146221 CDS Reference Asset 20.09.22/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.09.25 EUR 5%	20.09.2025 1.420.000,00 -1.420.000,00	EUR EUR	5,0000	9.243,54	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid
SWAPCDS146458 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.24 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.24 EUR 1%	20.06.2024 1.500.000,00 -1.500.000,00	EUR EUR	1,0000	-6.746,32	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS146725 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.24 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.24 EUR 1%	20.06.2024 940.000,00 -940.000,00	EUR EUR	1,0000	-4.227,70	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS146738 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 150.000,00 -150.000,00	EUR EUR	1,0000	13,69	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146739 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 800.000,00 -800.000,00	EUR EUR	1,0000	11.492,58	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
SWAPCDS146740 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 700.000,00 -700.000,00	EUR EUR	1,0000	10.056,00	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146741 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 150.000,00 -150.000,00	EUR EUR	1,0000	5.006,87	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146742 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	20.12.2032 2.400.000,00 -2.400.000,00	EUR EUR	1,0000	144.912,45	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS146743 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	20.12.2032 2.100.000,00 -2.100.000,00	EUR EUR	1,0000	126.798,40	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS146744 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	20.12.2032 850.000,00 -850.000,00	EUR EUR	1,0000	51.323,16	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146746 CDS Reference Asset 20.09.22/20.09.25 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.09.25 USD 1%	20.09.2025 640.000,00 -640.000,00	USD USD	1,0000	-2.559,36	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
SWAPCDS146792 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 300.000,00 -300.000,00	EUR EUR	1,0000	27,38	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146793 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 300.000,00 -300.000,00	EUR EUR	1,0000	4.309,72	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146794 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 300.000,00 -300.000,00	EUR EUR	1,0000	10.013,74	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146795 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	20.12.2032 1.700.000,00 -1.700.000,00	EUR EUR	1,0000	102.646,32	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146796 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 250.000,00 -250.000,00	EUR EUR	1,0000	-3.157,56	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146797 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 250.000,00 -250.000,00	EUR EUR	1,0000	-2.594,03	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146798 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.28 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.28 EUR 1%	20.12.2028 1.800.000,00 -1.800.000,00	EUR EUR	1,0000	-10.461,17	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS147111 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 500.000,00 -500.000,00	EUR EUR	1,0000	4.144,14	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS147112 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 912.500,00 -912.500,00	EUR EUR	1,0000	11.370,37	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS147113 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 1.010.000,00 -1.010.000,00	EUR EUR	1,0000	12.585,29	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS147114 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 730.000,00 -730.000,00	EUR EUR	1,0000	9.096,30	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS147133 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR TK Elevator Holdco GmbH Anleihe v.20(20/28) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 5%	20.12.2027 1.800.000,00 -1.800.000,00	EUR EUR	5,0000	-77.604,79	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid
SWAPCDS147222 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 3.500.000,00 -3.500.000,00	EUR EUR	1,0000	-22.294,62	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS147246 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.30 EUR DEUTSCHE BANK AKTIENGESELLSCHAFT Ref ID: XSLACREF CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.30 EUR 1%	20.12.2030 1.460.000,00 -1.460.000,00	EUR EUR	1,0000	60.647,77	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS147252 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.30 EUR DEUTSCHE BANK AKTIENGESELLSCHAFT Ref ID: XSLACREF CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.30 EUR 1%	20.12.2030 750.000,00 -750.000,00	EUR EUR	1,0000	31.154,67	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS147253 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Verisure Midholding AB EO-Notes 2021(21/29) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 5%	20.12.2027 900.000,00 -900.000,00	EUR EUR	5,0000	-19.613,55	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS147270 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 1.600.000,00 -1.600.000,00	EUR EUR	1,0000	13.261,25	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS147291 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 2.720.000,00 -2.720.000,00	EUR EUR	1,0000	-35.128,49	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS147358 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Barclays PLC EO-FLR Med.-Term Nts 18(18/26) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 430.000,00 -430.000,00	EUR EUR	1,0000	-1.551,16	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS147359 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Barclays PLC EO-FLR Med.-Term Nts 18(18/26) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 1.810.000,00 -1.810.000,00	EUR EUR	1,0000	8.582,88	Bank of America Securities Europe SA - Paris

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS147360 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Barclays PLC EO-FLR Med.-Term Nts 18(18/26) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 900.000,00 -900.000,00	EUR EUR	1,0000	4.267,73	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS148199 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 JPY 1%	20.12.2029 195.000.000,00 -195.000.000,00	JPY JPY	1,0000	45.711,83	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS148224 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 JPY 1%	20.12.2029 183.000.000,00 -183.000.000,00	JPY JPY	1,0000	42.898,79	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS148443 CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.28 EUR Societe Generale SRO LAC CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.28 EUR 1%	20.06.2028 1.500.000,00 -1.500.000,00	EUR EUR	1,0000	3.361,59	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS148514 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 375.000,00 -375.000,00	EUR EUR	1,0000	34,23	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148515 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 375.000,00 -375.000,00	EUR EUR	1,0000	5.387,15	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148516 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 375.000,00 -375.000,00	EUR EUR	1,0000	12.517,17	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148517 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.32 EUR 1%	20.12.2032 2.125.000,00 -2.125.000,00	EUR EUR	1,0000	128.307,90	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148518 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 JPY 1%	20.12.2027 82.500.000,00 -82.500.000,00	JPY JPY	1,0000	7.635,79	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
SWAPCDS148556 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 470.000,00 -470.000,00	EUR EUR	1,0000	-3.877,22	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148594 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SUB CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 100.000,00 -100.000,00	EUR EUR	1,0000	-605,88	Deutsche Bank AG Frankfurt

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS148595 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SUB CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 100.000,00 -100.000,00	EUR EUR	1,0000	2.045,28	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148596 CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.32 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SUB CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 800.000,00 -800.000,00	EUR EUR	1,0000	34.614,94	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148603 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 750.000,00 -750.000,00	EUR EUR	1,0000	-6.187,06	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148604 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SUB CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 100.000,00 -100.000,00	EUR EUR	1,0000	526,91	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148624 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 JPY 1%	20.12.2025 30.000.000,00 -30.000.000,00	JPY JPY	1,0000	-890,06	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS148625 CDS Reference Asset 20.12.22/20.09.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.09.27 JPY 1%	20.09.2027 325.000.000,00 -325.000.000,00	JPY JPY	1,0000	25.171,09	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS148628 CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.26 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBLO CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.26 EUR 1%	20.06.2026 1.250.000,00 -1.250.000,00	EUR EUR	1,0000	-10.482,75	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148642 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 2.000.000,00 -2.000.000,00	EUR EUR	1,0000	-16.498,82	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS148689 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2018(18/28) CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 USD 1%	20.12.2027 2.600.000,00 -2.600.000,00	USD USD	1,0000	162.014,42	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
SWAPCDS148720 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 JPY 1%	20.12.2027 44.000.000,00 -44.000.000,00	JPY JPY	1,0000	4.072,42	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
SWAPCDS148721 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 JPY 1%	20.12.2029 195.000.000,00 -195.000.000,00	JPY JPY	1,0000	45.711,83	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS148722 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 140.000,00 -140.000,00	EUR EUR	1,0000	-1.768,24	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS148723 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 970.000,00 -970.000,00	EUR EUR	1,0000	-10.064,83	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS149166 CDS Reference Asset 20.12.22/20.09.30 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.09.30 JPY 1%	20.09.2030 51.000.000,00 -51.000.000,00	JPY JPY	1,0000	14.329,02	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS149212 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 JPY 1%	20.12.2025 25.000.000,00 -25.000.000,00	JPY JPY	1,0000	-741,72	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS150375 CDS Reference Asset 20.12.22/20.09.27 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A CDS Gebührenleg 20.12.22/20.09.27 USD 5%	20.09.2027 900.000,00 -900.000,00	USD USD	5,0000	-108.811,12	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS150432 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 870.000,00 -870.000,00	EUR EUR	1,0000	-7.176,99	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS150433 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 870.000,00 -870.000,00	EUR EUR	1,0000	-7.176,99	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS150434 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 520.000,00 -520.000,00	EUR EUR	1,0000	-4.289,69	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS150435 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 1.220.000,00 -1.220.000,00	EUR EUR	1,0000	-10.064,28	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS150436 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 520.000,00 -520.000,00	EUR EUR	1,0000	-4.289,69	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS150548 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 1.330.000,00 -1.330.000,00	EUR EUR	1,0000	-10.971,72	Bank of America Securities Europe SA - Paris

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS150596 CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 1.400.000,00 -1.400.000,00	EUR EUR	1,0000	-11.549,17	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS150926 CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 540.000,00 -540.000,00	EUR EUR	1,0000	-4.454,68	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS150927 CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 360.000,00 -360.000,00	EUR EUR	1,0000	-2.969,79	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS150928 CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 1.800.000,00 -1.800.000,00	EUR EUR	1,0000	-14.848,94	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS151171 CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 1.800.000,00 -1.800.000,00	EUR EUR	1,0000	-14.848,94	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS151285 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 USD Pactiv LLC DL-Notes 1999(25) CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 USD 5%	20.12.2025 2.500.000,00 -2.500.000,00	USD USD	5,0000	-217.446,10	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS152143 CDS Reference Asset 20.03.23/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22) Reg.S CDS Gebührenleg 20.03.23/20.09.25 EUR 5%	20.09.2025 800.000,00 -800.000,00	EUR EUR	5,0000	5.207,63	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS152144 CDS Reference Asset 20.03.23/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22) Reg.S CDS Gebührenleg 20.03.23/20.09.25 EUR 5%	20.09.2025 380.000,00 -380.000,00	EUR EUR	5,0000	2.473,62	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS152254 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR Societe Generale SRO LAC CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 1%	20.06.2028 1.500.000,00 -1.500.000,00	EUR EUR	1,0000	3.361,59	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS152256 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBLO CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 700.000,00 -700.000,00	EUR EUR	1,0000	8.722,48	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS152304 CDS Reference Asset 20.03.23/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22) Reg.S CDS Gebührenleg 20.03.23/20.09.25 EUR 5%	20.09.2025 330.000,00 -330.000,00	EUR EUR	5,0000	2.148,15	Deutsche Bank AG Frankfurt

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS152305 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBL0 CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 1.160.000,00 -1.160.000,00	EUR EUR	1,0000	14.454,39	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS152712 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBL0 CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 1%	20.06.2028 1.000.000,00 -1.000.000,00	EUR EUR	1,0000	-3.578,56	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS153011 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBL0 CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 1%	20.06.2028 2.000.000,00 -2.000.000,00	EUR EUR	1,0000	-7.157,12	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS153101 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 USD Türkei, Republik DL-Bonds 2000(30) CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 USD 1%	20.06.2028 2.500.000,00 -2.500.000,00	USD USD	1,0000	346.514,41	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS153108 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SUB CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 1%	20.06.2028 2.700.000,00 -2.700.000,00	EUR EUR	1,0000	24.278,77	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS153112 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.25 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.25 EUR 1%	20.06.2025 1.300.000,00 -1.300.000,00	EUR EUR	1,0000	-9.746,81	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS153113 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.25 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.25 EUR 1%	20.06.2025 3.000.000,00 -3.000.000,00	EUR EUR	1,0000	-22.492,64	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS153114 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SUB CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 1%	20.06.2028 4.500.000,00 -4.500.000,00	EUR EUR	1,0000	40.464,61	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS153115 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 125.000.000,00 -125.000.000,00	JPY JPY	1,0000	15.315,42	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS153116 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.30 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.30 JPY 1%	20.06.2030 500.000.000,00 -500.000.000,00	JPY JPY	1,0000	134.987,67	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS153278 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR TK Elevator Holdco GmbH Anleihe v.20(20/28) Reg.S CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 5%	20.06.2028 1.000.000,00 -1.000.000,00	EUR EUR	5,0000	-29.987,81	HSBC Continental Europe S.A. - Paris

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS153322 CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28) CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.26 USD 1%	20.03.2026 1.650.000,00 -1.650.000,00	USD USD	1,0000	92.298,10	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS153323 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.25 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.25 EUR 1%	20.06.2025 1.900.000,00 -1.900.000,00	EUR EUR	1,0000	-14.245,34	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS153424 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 USD Louisiana Pacific Corp. DL-Notes 2021(21/29) 144A CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 USD 5%	20.06.2028 2.000.000,00 -2.000.000,00	USD USD	5,0000	-298.094,82	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS153425 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 USD Louisiana Pacific Corp. DL-Notes 2021(21/29) 144A CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 USD 5%	20.06.2028 1.000.000,00 -1.000.000,00	USD USD	5,0000	-149.047,41	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
SWAPCDS153426 CDS Reference Asset 20.03.23/20.12.27 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S CDS Gebührenleg 20.03.23/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 3.850.000,00 -3.850.000,00	EUR EUR	1,0000	-39.948,04	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS153451 CDS Reference Asset 20.03.23/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2020(25) CDS Gebührenleg 20.03.23/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 4.250.000,00 -4.250.000,00	EUR EUR	1,0000	35.225,18	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS153487 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.33 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2020(25) CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.33 EUR 1%	20.06.2033 2.500.000,00 -2.500.000,00	EUR EUR	1,0000	83.125,32	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS153488 CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.27 EUR Societe Generale SRO LAC CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.27 EUR 1%	20.03.2027 2.125.000,00 -2.125.000,00	EUR EUR	1,0000	-13.492,99	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS153545 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.33 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2020(25) CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.33 EUR 1%	20.06.2033 2.500.000,00 -2.500.000,00	EUR EUR	1,0000	83.125,32	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS153546 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.33 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2020(25) CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.33 EUR 1%	20.06.2033 2.500.000,00 -2.500.000,00	EUR EUR	1,0000	83.125,32	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS153564 CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.25 EUR Societe Generale SRO LAC CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 3.000.000,00 -3.000.000,00	EUR EUR	1,0000	-26.014,86	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin

XAIA Credit Basis

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS153655	20.12.2025				
CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.25 EUR Societe Generale SRO LAC	6.000.000,00	EUR		-52.029,71	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.25 EUR 1%	-6.000.000,00	EUR	1,0000		
SWAPCDS153674	20.03.2025				
CDS Reference Asset 20.06.23/20.03.25 EUR UBS Group AG EO-Notes 2016(23/24)	3.000.000,00	EUR		-18.083,14	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.03.25 EUR 1%	-3.000.000,00	EUR	1,0000		
Credit Default Swaps gesamt				3.117.164,01	
Swaps gesamt				12.571.253,24	
Derivate gesamt				15.585.060,64	

XAIA Credit Basis

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

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2020	Stück	259.079,613	EUR	278.820.655,22	EUR	1.076,20
2021	Stück	248.138,069	EUR	267.568.433,68	EUR	1.078,30
2022	Stück	221.885,069	EUR	278.820.655,22	EUR	1.078,33
30.06.2023	Stück	189.130,069	EUR	207.369.447,34	EUR	1.096,44

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	221.885,069
Ausgegebene Anteile	33.800,000
Zurückgenommene Anteile	-66.555,000
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	189.130,069

XAIA Credit Basis

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

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2020	Stück	137,000	EUR	141.979,09	EUR	1.036,34
2021	Stück	107,000	EUR	109.827,33	EUR	1.026,42
2022	Stück	107,000	EUR	107.843,60	EUR	1.007,88
30.06.2023	Stück	57,000	EUR	58.132,21	EUR	1.019,86

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	107,000
Ausgegebene Anteile	0,000
Zurückgenommene Anteile	-50,000
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	57,000

XAIA Credit Basis

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

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2020	Stück	45.140,028	EUR	50.871.405,36	EUR	1.126,97
2021	Stück	71.640,028	EUR	81.909.634,96	EUR	1.143,35
2022	Stück	71.640,028	EUR	82.676.162,49	EUR	1.154,05
30.06.2023	Stück	69.061,838	EUR	81.042.648,42	EUR	1.173,48

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	71.640,028
Ausgegebene Anteile	0,000
Zurückgenommene Anteile	-2.578,190
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	69.061,838

XAIA Credit Basis II

Vermögensübersicht zum 30.06.2023

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen *)
I. Vermögensgegenstände	510.033.760,01	106,16
1. Anleihen	421.646.676,38	87,76
2. Derivate	30.440.475,30	6,34
3. Bankguthaben	48.047.606,78	10,00
4. Sonstige Vermögensgegenstände	9.899.001,55	2,06
II. Verbindlichkeiten	-29.584.413,92	-6,16
III. Fondsvermögen	480.449.346,09	100,00

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

XAIA Credit Basis II

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2023	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
Bestandspositionen				EUR		421.646.676,38	87,76
Börsengehandelte Wertpapiere				EUR		147.502.707,34	30,70
Verzinsliche Wertpapiere				EUR		147.502.707,34	30,70
1,0000 % Teva Pharmac.Fin.NL IV B.V. SF-Schuldversch. 2016(25)	CH0333827506	%	2.200	CHF	94,213	2.124.078,12	0,44
5,6000 % Commerzbank AG Nachr.Inh.Schv.A.N317 v.03(23)	DE0001611044	%	4.360	EUR	99,996	4.359.834,51	0,91
5,0000 % SoftBank Group Corp. EO-Notes 2018(18/28)	XS1793255941	%	27.300	EUR	92,827	25.341.720,84	5,27
2,8750 % SoftBank Group Corp. EO-Notes 2021(21/27)	XS2361254597	%	11.700	EUR	88,026	10.299.021,51	2,14
4,1770 % UBS Group AG EO-FLR Med.-T. Nts 2021(25/26)	CH0591979635	%	60.700	EUR	98,329	59.685.651,90	12,42
5,1250 % Ladbrokes Group Finance PLC LS-Notes 2016(16/23)	XS1514268165	%	5.054	GBP	99,588	5.866.845,12	1,22
7,3850 % Barclays PLC DL-FLR Notes 2022(22/28)	US06738ECD58	%	6.000	USD	104,076	5.724.234,40	1,19
6,9500 % Bath & Body Works Inc. DL-Debts 2003(03/33)	US532716AK37	%	7.000	USD	89,149	5.720.412,15	1,19
7,6000 % Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2007(07/37)	US532716AN75	%	7.000	USD	88,447	5.675.418,17	1,18
4,7550 % HSBC Holdings PLC DL-FLR Notes 2022(22/28)	US404280DF39	%	6.000	USD	95,854	5.272.039,31	1,10
7,4500 % New Albertsons L.P. DL-Debts. 1999(99/29)	US013104AF19	%	3.449	USD	102,352	3.235.971,07	0,67
7,2500 % Safeway Inc. DL-Debts 2001(31)	US786514BA67	%	4.000	USD	102,796	3.769.210,19	0,78
7,4500 % Safeway Inc. DL-Debts. 1997(97/27)	US786514AS84	%	1.500	USD	104,953	1.443.117,34	0,30
7,7670 % Standard Chartered PLC DL-FLR Notes 2022(27/28) 144A	US853254CN89	%	6.000	USD	106,061	5.833.426,12	1,21
5,7500 % Türkei, Republik DL-Notes 2017(47)	US900123CM05	%	5.000	USD	68,764	3.151.726,59	0,66
An regulierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				EUR		235.256.134,92	48,97
Verzinsliche Wertpapiere				EUR		235.256.134,92	48,97
3,1250 % Aramark Intl Finance S.à.r.l. EO-Notes 2017(17/25) Reg.S	XS1586831999	%	2.560	EUR	95,515	2.445.189,18	0,51
0,1250 % Argentinien, Republik EO-Notes 2020(20/24-30)	XS2177363665	%	9.500	EUR	27,981	2.658.190,42	0,55
7,6250 % Carnival Corp. EO-Notes 2020(20/26) Reg.S	XS2264155305	%	16.850	EUR	97,280	16.391.700,24	3,41
3,6250 % Netflix Inc. EO-Notes 2019(19/30) Reg.S	XS2072829794	%	1.000	EUR	95,275	952.746,68	0,20
3,7500 % Stena International S.A. EO-Notes 2020(20/25) Reg.S	XS2110768525	%	950	EUR	96,513	916.876,04	0,19
9,0730 % Stonegate Pub Comp.Fin.19 PLC EO-FLR Notes 2020(20/25) Reg.S	XS2210013970	%	9.700	EUR	93,167	9.037.165,96	1,88
4,5000 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. EO-Notes 2018(18/25)	XS1813724603	%	1.972	EUR	98,755	1.947.440,18	0,41
3,7500 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. EO-Notes 2021(21/27)	XS2406607098	%	1.850	EUR	90,213	1.668.944,78	0,35
6,6250 % TK Elevator Holdco GmbH Anleihe v.20(20/28) Reg.S	XS2198191962	%	5.900	EUR	85,650	4.547.988,55	0,95
5,2500 % Verisure Midholding AB EO-Notes 2021(21/29) Reg.S	XS2287912450	%	8.660	EUR	86,514	7.492.070,58	1,56
6,6250 % Amkor Technology Inc. DL-Notes 2019(19/27) 144A	US031652BK50	%	4.000	USD	99,564	3.650.711,33	0,76
6,3750 % Aramark Services Inc. DL-Notes 2020(20/25) 144A	US038522AR99	%	15.000	USD	99,885	13.734.239,26	2,86
5,7500 % Avient Corp. DL-Notes 2020(20/25)	US73179PAM86	%	15.000	USD	98,405	13.530.808,74	2,82
4,7500 % Boyd Gaming Corp. DL-Notes 2020(20/27)	US103304BU40	%	6.780	USD	94,573	5.877.746,34	1,22
3,5470 % Deutsche Bank AG FLR-DL-Senior Nts v.20(30/31)	US251526CD98	%	5.000	USD	82,576	3.784.768,46	0,79
6,2500 % Expedia Group Inc. DL-Notes 2020(20/25) 144A	US30212PAS48	%	4.000	USD	100,056	3.668.742,79	0,76

XAIA Credit Basis II

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2023	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
5,1250 % Howmet Aerospace Inc. DL-Notes 2014(14/24)	US013817AW16	%	5.402	USD	98,722	4.888.605,46	1,02
8,2480 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-FLR Pref.MTN 22(32/33) 144A	US46115HBV87	%	16.000	USD	104,723	15.359.519,65	3,20
6,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-Notes 2023(33) 144A X	US46115HBZ91	%	5.000	USD	99,111	4.542.629,46	0,95
7,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-Pref.Med.-T.Nts 22(25) 144A	US46115HBU05	%	6.500	USD	100,933	6.013.996,66	1,25
4,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-Receipts 2019(29) Cl.X 144A	US46115HBL06	%	4.300	USD	86,957	3.427.569,30	0,71
4,8750 % Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A	US46284VAC54	%	4.000	USD	93,525	3.429.288,67	0,71
5,0000 % Iron Mountain Inc. DL-Notes 2020(20/28) 144A	US46284VAG68	%	2.836	USD	91,951	2.390.451,18	0,50
3,6250 % Louisiana Pacific Corp. DL-Notes 2021(21/29) 144A	US546347AM73	%	3.350	USD	86,608	2.659.611,48	0,55
5,2500 % MGIC Investment Corp. DL-Notes 2020(20/28)	US552848AG81	%	7.600	USD	93,920	6.543.118,48	1,36
4,8100 % Nissan Motor Co. Ltd. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USJ57160DZ32	%	25.220	USD	87,253	20.171.670,76	4,20
9,5000 % Olin Corp. DL-Notes 2020(20/25) 144A	US680665AM82	%	7.200	USD	104,795	6.916.547,00	1,44
5,3750 % Ovintiv Inc. DL-Notes 2015(15/26)	US651290AR99	%	7.870	USD	98,967	7.139.701,57	1,49
7,9500 % Pactiv LLC DL-Notes 1999(25)	US880394AB71	%	5.500	USD	101,293	5.106.882,93	1,06
6,6250 % Radian Group Inc. DL-Notes 2020(20/25)	US750236AX98	%	4.191	USD	99,908	3.838.230,35	0,80
1,4880 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 20(25/26)Reg.S	US83368TAZ12	%	6.000	USD	87,836	4.831.025,88	1,01
2,7970 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 22(27/28)Reg.S	US83368TBH05	%	2.500	USD	88,187	2.020.972,61	0,42
6,4460 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 23(28/29) 144A	US83368RBR21	%	5.500	USD	100,131	5.048.323,55	1,05
7,8750 % Sprint Corp. DL-Notes 2014(14/23)	US85207UAF21	%	18.900	USD	100,243	17.367.166,63	3,61
7,6250 % Sprint Corp. DL-Notes 2018(18/26)	US85207UAK16	%	8.350	USD	103,705	7.937.854,96	1,65
7,0000 % Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S	USW8758PAK22	%	800	USD	99,770	731.650,65	0,15
6,8750 % Targa Resources Part.L.P./Fin. DL-Notes 2019(19/29)	US87612BBN10	%	7.321	USD	101,223	6.793.030,68	1,41
7,5000 % Transdigm Inc. DL-Notes 2019(19/27)	US893647BH98	%	3.700	USD	99,550	3.376.435,54	0,70
1,9820 % UniCredit S.p.A. DL-FLR Pref. MTN 2021(26/27)	XS2348710562	%	3.000	USD	87,873	2.416.521,94	0,50
Nichtnotierte Wertpapiere				EUR		38.887.834,12	8,09
Verzinsliche Wertpapiere				EUR		38.887.834,12	8,09
0,0000 % Banco Espirito Santo S.A. EO-Medium-Term Notes 2011(16)	PTBEQBOM0010	%	14.400	EUR	23,009	3.313.268,36	0,69
0,0000 % Banco Espirito Santo S.A. EO-Medium-Term Notes 2014(17)	PTBEQKOM0019	%	6.000	EUR	23,009	1.380.528,48	0,29
0,0000 % Galapagos Holding S.A. EO-Notes 2014(17/22) Reg.S	XS1071420027	%	100	EUR	1,000	1.000,35	0,00
4,2000 % Banque Centrale de Tunisie YN-Bonds 2001(31)	XS0126471233	%	500.000	JPY	41,514	1.316.600,46	0,27
3,5000 % Banque Centrale de Tunisie YN-Med.-Term Nts 2003(33)	XS0162198351	%	500.000	JPY	41,037	1.301.450,66	0,27
7,5000 % Alb.Cos LLC/Safe.Inc/N.A.I./A. DL-Notes 2019(19/26) 144A	US013092AA91	%	9.000	USD	101,495	8.373.376,71	1,74
7,6250 % HSBC Holdings PLC DL-Notes 2022(32)	US404280DK24	%	1.000	USD	104,443	957.403,41	0,20
8,2480 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-FLR Pref.MTN 22(32/33)Reg.S	XS2559133363	%	5.000	USD	104,723	4.799.849,89	1,00
4,6250 % Level 3 Financing Inc. DL-Notes 2019(19/27) 144A	US527298BN21	%	2.775	USD	68,486	1.742.124,11	0,36
1,4880 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 20(25/26) 144A	US83368RAZ55	%	3.500	USD	87,836	2.818.098,43	0,59
3,1270 % UniCredit S.p.A. DL-FLR Pref. MTN 2021(31/32)	US904678AY53	%	13.850	USD	79,101	10.042.642,60	2,09
6,8750 % Unisys Corp. DL-Notes 2020(20/27) 144A	US909214BV97	%	4.350	USD	71,259	2.841.490,66	0,59
Summe Wertpapiervermögen				EUR		421.646.676,38	87,76

XAIA Credit Basis II

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2023	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)	
Derivate						EUR	30.440.475,30	6,34
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	48.047.606,78	10,00
Bankguthaben						EUR	48.047.606,78	10,00
Guthaben bei Skandinaviska Enskilda Banken AB Stockholm Vorzeitig kündbares Termingeld								
			560,00	CHF		573,89	0,00	
			526.951,00	JPY		3.342,39	0,00	
Guthaben bei Bayerische Landesbank München Vorzeitig kündbares Termingeld								
			15.000.000,00	EUR		15.000.000,00	3,12	
Guthaben bei Landesbank Baden-Württemberg Stuttgart Vorzeitig kündbares Termingeld								
			1.000.000,00	EUR		1.000.000,00	0,21	
			15.000.000,00	USD		13.750.114,58	2,86	
Guthaben bei SUMITOMO MITSUI TRUST BANK Ltd. GB Vorzeitig kündbares Termingeld								
			13.746.607,95	EUR		13.746.607,95	2,86	
			4.644,20	GBP		5.413,45	0,00	
Guthaben bei Citibank N.A. New York Vorzeitig kündbares Termingeld								
			4.954.381,82	USD		4.541.554,51	0,95	
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	9.899.001,55	2,06
Zinsansprüche								
			6.357.433,67	EUR		6.357.433,67	1,33	
Zinsansprüche Swaps								
			3.507.619,93	EUR		3.507.619,93	0,73	
Sonstige Forderungen								
			33.947,95	EUR		33.947,95	0,00	

XAIA Credit Basis II

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2023	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme				EUR		-26.961.593,01	-5,61
Kredite bei Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.							
EUR - Kredite			-929.363,50	EUR		-929.363,50	-0,19
EUR - Kredite (Cash Collateral)			-26.000.000,00	EUR		-26.000.000,00	-5,41
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen							
			-35.159,17	USD		-32.229,51	-0,01
Verbindlichkeiten				EUR		-2.622.820,91	-0,53
Zinsverbindlichkeiten Swaps							
			-2.168.130,31	EUR		-2.168.130,31	-0,45
Verwaltungsvergütung							
			-327.583,56	EUR		-327.583,56	-0,07
Verwahrstellenvergütung							
			-13.968,13	EUR		-13.968,13	0,00
Depotgebühren							
			-49.447,52	EUR		-49.447,52	-0,01
Prüfungs- und Veröffentlichungskosten							
			-16.000,00	EUR		-16.000,00	0,00
Taxe d'abonnement							
			-12.610,63	EUR		-12.610,63	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten							
			-35.080,76	EUR		-35.080,76	0,00
Fondsvermögen				EUR		480.449.346,09	100,00
XAIA Credit Basis II (I)							
Anteilwert				EUR		991,41	
Ausgabepreis				EUR		991,41	
Rücknahmepreis				EUR		991,41	
Anteile im Umlauf				STK		284.840,673	
XAIA Credit Basis II (P)							
Anteilwert				EUR		96,55	
Ausgabepreis				EUR		98,96	
Rücknahmepreis				EUR		96,55	
Anteile im Umlauf				STK		46.149,130	

XAIA Credit Basis II

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2023	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
XAIA Credit Basis II (IT)							
Anteilwert				EUR		1.129,94	
Ausgabepreis				EUR		1.129,94	
Rücknahmepreis				EUR		1.129,94	
Anteile im Umlauf				STK		169.952,947	
XAIA Credit Basis II (R)							
Anteilwert				EUR		102,61	
Ausgabepreis				EUR		105,18	
Rücknahmepreis				EUR		102,61	
Anteile im Umlauf				STK		15.242,000	

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

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Devisentermingeschäfte zum 30.06.2023

	Währung 1	Betrag 1		Währung 2	Betrag 2	Fälligkeit	Unreal. Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Verkauf	CHF	-2.033.000,00	Kauf	EUR	2.100.879,41	07.07.2023	16.653,12	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	GBP	-3.330.000,00	Kauf	EUR	3.867.550,90	07.07.2023	-12.884,28	J.P. Morgan SE Frankfurt
Verkauf	JPY	-1.217.000.000,00	Kauf	EUR	8.192.828,35	07.07.2023	468.017,05	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	JPY	-23.100.000,00	Kauf	EUR	149.295,95	07.07.2023	2.670,53	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Verkauf	USD	-322.000.000,00	Kauf	EUR	300.643.769,81	07.07.2023	5.569.854,71	J.P. Morgan SE Frankfurt
Kauf	USD	2.000.000,00	Verkauf	EUR	-1.850.385,25	07.07.2023	-17.628,01	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Kauf	USD	2.000.000,00	Verkauf	EUR	-1.849.197,91	07.07.2023	-16.440,67	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Devisentermingeschäfte gesamt							6.010.242,45	

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Zinsswaps					
SWAPIRS030083207	13.04.2028				
Floating Leg 13.04.18/13.04.28 EUR 3,672% (Floater)	9.000.000,00	EUR	3,1080 variabel	929.456,36	Goldman Sachs International Limited London
Fixed Leg 13.04.18/13.04.28 EUR 0,8445% (Zinssatz fest)	-9.000.000,00	EUR	0,8445 fix		
SWAPIRS030088643	20.08.2026				
Floating Leg 20.08.18/20.08.26 EUR 3,383% (Floater)	4.200.000,00	EUR	3,3830 variabel	356.810,85	Goldman Sachs International Limited London
Fixed Leg 20.08.18/20.08.26 EUR 0,5865% (Zinssatz fest)	-4.200.000,00	EUR	0,5865 fix		
SWAPIRS030092105	23.10.2028				
Floating Leg 23.10.18/23.10.28 JPY 0,04761% (Floater)	470.000.000,00	JPY	0,0476 variabel	-11.683,09	Goldman Sachs International Limited London
Fixed Leg 23.10.18/23.10.28 JPY 0,3775% (Zinssatz fest)	-470.000.000,00	JPY	0,3775 fix		
SWAPIRS107523	01.11.2024				
Floating Leg 01.11.19/01.11.24 EUR 3,725% (Floater)	17.000.000,00	EUR	3,2500 variabel	917.549,60	J.P. Morgan SE Frankfurt
Fixed Leg 01.11.19/01.11.24 EUR -0,307% (Zinssatz fest)	-17.000.000,00	EUR	-0,3070 fix		
SWAPIRS110557	24.01.2029				
Floating Leg 24.01.20/24.01.29 EUR 3,698% (Floater)	1.500.000,00	EUR	3,2110 variabel	236.550,01	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 24.01.20/24.01.29 EUR -0,012% (Zinssatz fest)	-1.500.000,00	EUR	-0,0120 fix		
SWAPIRS110561	22.01.2024				
Floating Leg 22.01.20/22.01.24 GBP 4,4781% (Floater)	5.000.000,00	GBP	4,4781 variabel	166.700,90	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 22.01.20/22.01.24 GBP 0,6965% (Zinssatz fest)	-5.000.000,00	GBP	0,6965 fix		
SWAPIRS111916	10.03.2028				
Floating Leg 10.03.20/10.03.28 USD 5,53971% (Floater)	5.000.000,00	USD	5,5397 variabel	668.249,69	Deutsche Bank AG London
Fixed Leg 10.03.20/10.03.28 USD 0,771% (Zinssatz fest)	-5.000.000,00	USD	0,7710 fix		
SWAPIRS111918	10.03.2026				
Floating Leg 10.03.20/10.03.26 USD 5,53971% (Floater)	5.300.000,00	USD	5,5397 variabel	494.722,78	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 10.03.20/10.03.26 USD 0,71% (Zinssatz fest)	-5.300.000,00	USD	0,7100 fix		
SWAPIRS114023	21.04.2028				
Floating Leg 21.04.20/21.04.28 EUR 3,646% (Floater)	5.000.000,00	EUR	3,2050 variabel	747.255,40	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 21.04.20/21.04.28 EUR -0,208% (Zinssatz fest)	-5.000.000,00	EUR	-0,2080 fix		
SWAPIRS114290	29.04.2026				
Floating Leg 29.04.20/29.04.26 USD 5,63073% (Floater)	10.100.000,00	USD	5,2727 variabel	1.021.931,00	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 29.04.20/29.04.26 USD 0,5% (Zinssatz fest)	-10.100.000,00	USD	0,5000 fix		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPIRS114491	12.05.2028				
Floating Leg 12.05.20/12.05.28 USD 5,34243% (Floater)	700.000,00	USD	5,3424 variabel	101.096,49	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 12.05.20/12.05.28 USD 0,574% (Zinssatz fest)	-700.000,00	USD	0,5740 fix		
SWAPIRS114493	12.05.2027				
Floating Leg 12.05.20/12.05.27 USD 5,34243% (Floater)	4.800.000,00	USD	5,3424 variabel	597.855,06	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 12.05.20/12.05.27 USD 0,5275% (Zinssatz fest)	-4.800.000,00	USD	0,5275 fix		
SWAPIRS114495	12.05.2025				
Floating Leg 12.05.20/12.05.25 USD 5,34243% (Floater)	13.500.000,00	USD	5,3424 variabel	1.032.312,81	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 12.05.20/12.05.25 USD 0,4035% (Zinssatz fest)	-13.500.000,00	USD	0,4035 fix		
SWAPIRS115264	01.06.2025				
Floating Leg 01.06.20/01.06.25 USD 5,496% (Floater)	11.000.000,00	USD	5,4960 variabel	864.733,08	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 01.06.20/01.06.25 USD 0,392% (Zinssatz fest)	-11.000.000,00	USD	0,3920 fix		
SWAPIRS115265	01.06.2026				
Floating Leg 01.06.20/01.06.26 USD 5,496% (Floater)	3.500.000,00	USD	5,4960 variabel	365.751,75	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 01.06.20/01.06.26 USD 0,46% (Zinssatz fest)	-3.500.000,00	USD	0,4600 fix		
SWAPIRS115274	02.06.2025				
Floating Leg 02.06.20/02.06.25 EUR 3,463% (Floater)	4.500.000,00	EUR	3,4630 variabel	339.808,58	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 02.06.20/02.06.25 EUR -0,3525% (Zinssatz fest)	-4.500.000,00	EUR	-0,3525 fix		
SWAPIRS115734	16.06.2024				
Floating Leg 16.06.20/16.06.24 USD 5,50843% (Floater)	13.500.000,00	USD	5,5084 variabel	609.543,55	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 16.06.20/16.06.24 USD 0,3235% (Zinssatz fest)	-13.500.000,00	USD	0,3235 fix		
SWAPIRS115735	16.06.2025				
Floating Leg 16.06.20/16.06.25 USD 5,50843% (Floater)	13.000.000,00	USD	5,5084 variabel	1.040.069,70	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 16.06.20/16.06.25 USD 0,3835% (Zinssatz fest)	-13.000.000,00	USD	0,3835 fix		
SWAPIRS115736	16.06.2026				
Floating Leg 16.06.20/16.06.26 USD 5,50843% (Floater)	5.700.000,00	USD	5,5084 variabel	601.869,14	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 16.06.20/16.06.26 USD 0,4575% (Zinssatz fest)	-5.700.000,00	USD	0,4575 fix		
SWAPIRS115739	16.06.2029				
Floating Leg 16.06.20/16.06.29 USD 5,50843% (Floater)	3.900.000,00	USD	5,5084 variabel	631.285,02	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 16.06.20/16.06.29 USD 0,6475% (Zinssatz fest)	-3.900.000,00	USD	0,6475 fix		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPIRS115740	16.06.2032				
Floating Leg 16.06.20/16.06.32 USD 5,50843% (Floater)	1.300.000,00	USD	5,5084 variabel	272.656,04	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 16.06.20/16.06.32 USD 0,7795% (Zinssatz fest)	-1.300.000,00	USD	0,7795 fix		
SWAPIRS117979	12.08.2027				
Floating Leg 12.08.20/12.08.27 USD 5,34243% (Floater)	7.500.000,00	USD	5,3424 variabel	1.002.297,66	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 12.08.20/12.08.27 USD 0,423% (Zinssatz fest)	-7.500.000,00	USD	0,4230 fix		
SWAPIRS117980	12.08.2025				
Floating Leg 12.08.20/12.08.25 USD 5,34243% (Floater)	15.000.000,00	USD	5,3424 variabel	1.290.950,98	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 12.08.20/12.08.25 USD 0,299% (Zinssatz fest)	-15.000.000,00	USD	0,2990 fix		
SWAPIRS118375	28.08.2025				
Floating Leg 28.08.20/28.08.25 EUR 3,457% (Floater)	2.300.000,00	EUR	3,4570 variabel	194.616,82	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 28.08.20/28.08.25 EUR -0,415% (Zinssatz fest)	-2.300.000,00	EUR	-0,4150 fix		
SWAPIRS118512	02.09.2023				
Floating Leg 02.09.20/02.09.23 USD 5,51671% (Floater)	17.000.000,00	USD	5,5167 variabel	150.476,75	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 02.09.20/02.09.23 USD 0,24625% (Zinssatz fest)	-17.000.000,00	USD	0,2463 fix		
SWAPIRS118517	02.09.2026				
Floating Leg 02.09.20/02.09.26 USD 5,51671% (Floater)	3.000.000,00	USD	5,5167 variabel	335.610,76	Deutsche Bank AG London
Fixed Leg 02.09.20/02.09.26 USD 0,42% (Zinssatz fest)	-3.000.000,00	USD	0,4200 fix		
SWAPIRS118518	02.09.2029				
Floating Leg 02.09.20/02.09.29 USD 5,51671% (Floater)	2.700.000,00	USD	5,5167 variabel	447.806,50	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 02.09.20/02.09.29 USD 0,65625% (Zinssatz fest)	-2.700.000,00	USD	0,6563 fix		
SWAPIRS121604	28.01.2025				
Floating Leg 28.01.21/28.01.25 EUR 3,714% (Floater)	4.000.000,00	EUR	3,2420 variabel	263.213,33	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 28.01.21/28.01.25 EUR -0,512% (Zinssatz fest)	-4.000.000,00	EUR	-0,5120 fix		
SWAPIRS121608	28.01.2031				
Floating Leg 28.01.21/28.01.31 USD 5,6272% (Floater)	4.000.000,00	USD	5,2727 variabel	673.579,96	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 28.01.21/28.01.31 USD 1,073% (Zinssatz fest)	-4.000.000,00	USD	1,0730 fix		
SWAPIRS121622	28.01.2025				
Floating Leg 28.01.21/28.01.25 USD 5,6272% (Floater)	18.200.000,00	USD	5,2727 variabel	1.226.645,14	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 28.01.21/28.01.25 USD 0,382% (Zinssatz fest)	-18.200.000,00	USD	0,3820 fix		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit	Nominale 1	Nominale 2	Whg 1	Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPIRS122555	24.02.2025							
Floating Leg 24.02.21/24.02.25 USD 5,37471% (Floater)	8.200.000,00	USD	5,3747	variabel		557.845,29	Deutsche Bank AG Frankfurt	
Fixed Leg 24.02.21/24.02.25 USD 0,5225% (Zinssatz fest)	-8.200.000,00	USD	0,5225	fix				
SWAPIRS127144	10.06.2028							
Floating Leg 10.06.21/10.06.28 EUR 3,486% (Floater)	2.000.000,00	EUR	3,4860	variabel		301.720,47	Deutsche Bank AG Frankfurt	
Fixed Leg 10.06.21/10.06.28 EUR -0,167% (Zinssatz fest)	-2.000.000,00	EUR	-0,1670	fix				
SWAPIRS127145	10.06.2033							
Floating Leg 10.06.21/10.06.33 USD 5,53971% (Floater)	2.300.000,00	USD	5,5397	variabel		378.653,67	Deutsche Bank AG Frankfurt	
Fixed Leg 10.06.21/10.06.33 USD 1,64% (Zinssatz fest)	-2.300.000,00	USD	1,6400	fix				
SWAPIRS129682	30.09.2023							
Floating Leg 30.09.21/30.09.23 EUR 3,598% (Floater)	11.200.000,00	EUR	2,9900	variabel		111.925,06	BNP Paribas S.A. Paris	
Fixed Leg 30.09.21/30.09.23 EUR -0,4575% (Zinssatz fest)	-11.200.000,00	EUR	-0,4575	fix				
SWAPIRS129685	30.09.2026							
Floating Leg 30.09.21/30.09.26 EUR 3,598% (Floater)	4.000.000,00	EUR	2,9900	variabel		445.759,52	Deutsche Bank AG Frankfurt	
Fixed Leg 30.09.21/30.09.26 EUR -0,217% (Zinssatz fest)	-4.000.000,00	EUR	-0,2170	fix				
SWAPIRS130877	11.11.2028							
Floating Leg 11.11.21/11.11.28 EUR 3,27% (Floater)	2.600.000,00	EUR	3,2700	variabel		407.202,85	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt	
Fixed Leg 11.11.21/11.11.28 EUR -0,08% (Zinssatz fest)	-2.600.000,00	EUR	-0,0800	fix				
SWAPIRS133059	24.01.2026							
Floating Leg 24.01.22/24.01.26 EUR 3,698% (Floater)	8.000.000,00	EUR	3,2110	variabel		701.864,08	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt	
Fixed Leg 24.01.22/24.01.26 EUR -0,004% (Zinssatz fest)	-8.000.000,00	EUR	-0,0040	fix				
SWAPIRS133885	24.02.2028							
Floating Leg 24.02.22/24.02.28 USD 4,91323% (Floater)	4.800.000,00	USD	4,8664	variabel		419.424,48	BNP Paribas S.A. Paris	
Fixed Leg 24.02.22/24.02.28 USD 1,6561% (Zinssatz fest)	-4.800.000,00	USD	1,6561	fix				
SWAPIRS135769	01.04.2034							
Floating Leg 01.04.22/01.04.34 USD 5,00233% (Floater)	2.800.000,00	USD	4,9676	variabel		301.443,98	Deutsche Bank AG Frankfurt	
Fixed Leg 01.04.22/01.04.34 USD 2,172% (Zinssatz fest)	-2.800.000,00	USD	2,1720	fix				
SWAPIRS135780	04.04.2029							
Floating Leg 04.04.22/04.04.29 USD 5,0037% (Floater)	1.000.000,00	USD	4,9721	variabel		76.222,72	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt	
Fixed Leg 04.04.22/04.04.29 USD 2,145% (Zinssatz fest)	-1.000.000,00	USD	2,1450	fix				

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit	Nominale 1	Nominale 2	Whg 1	Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPIRS136633	29.04.2027							
Floating Leg 29.04.22/29.04.27 EUR 3,714% (Floater)		3.500.000,00		EUR		3,2420 variabel	265.829,90	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 29.04.22/29.04.27 EUR 1,207% (Zinssatz fest)		-3.500.000,00		EUR		1,2070 fix		
SWAPIRS140225	17.06.2027							
Floating Leg 17.06.22/17.06.27 EUR 3,547% (Floater)		1.800.000,00		EUR		3,5470 variabel	77.101,47	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 17.06.22/17.06.27 EUR 2,162% (Zinssatz fest)		-1.800.000,00		EUR		2,1620 fix		
SWAPIRS142254	05.08.2030							
Floating Leg 05.08.22/05.08.30 EUR 3,275% (Floater)		1.000.000,00		EUR		3,2750 variabel	91.398,16	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 05.08.22/05.08.30 EUR 1,58% (Zinssatz fest)		-1.000.000,00		EUR		1,5800 fix		
SWAPIRS142666	18.08.2026							
Floating Leg 18.08.22/18.08.26 EUR 3,382% (Floater)		5.000.000,00		EUR		3,3820 variabel	306.050,15	Deutsche Bank AG London
Fixed Leg 18.08.22/18.08.26 EUR 1,398% (Zinssatz fest)		-5.000.000,00		EUR		1,3980 fix		
SWAPIRS146124	28.10.2027							
Floating Leg 28.10.22/28.10.27 EUR 3,714% (Floater)		3.000.000,00		EUR		3,2420 variabel	52.613,08	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 28.10.22/28.10.27 EUR 2,843% (Zinssatz fest)		-3.000.000,00		EUR		2,8430 fix		
SWAPIRS146919	21.11.2032							
Floating Leg 21.11.22/21.11.32 USD 4,65842% (Floater)		10.500.000,00		USD		4,6010 variabel	84.042,40	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 21.11.22/21.11.32 USD 3,427% (Zinssatz fest)		-10.500.000,00		USD		3,4270 fix		
SWAPIRS146920	21.11.2028							
Floating Leg 21.11.22/21.11.28 USD 4,65842% (Floater)		5.700.000,00		USD		4,6010 variabel	52.500,48	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 21.11.22/21.11.28 USD 3,612% (Zinssatz fest)		-5.700.000,00		USD		3,6120 fix		
SWAPIRS147124	23.11.2027							
Floating Leg 23.11.22/23.11.27 EUR 3,415% (Floater)		3.000.000,00		EUR		3,4150 variabel	75.184,28	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 23.11.22/23.11.27 EUR 2,653% (Zinssatz fest)		-3.000.000,00		EUR		2,6530 fix		
SWAPIRS147126	23.11.2028							
Floating Leg 23.11.22/23.11.28 EUR 3,415% (Floater)		2.300.000,00		EUR		3,4150 variabel	57.283,15	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 23.11.22/23.11.28 EUR 2,647% (Zinssatz fest)		-2.300.000,00		EUR		2,6470 fix		
SWAPIRS147128	23.11.2031							
Floating Leg 23.11.22/23.11.31 USD 4,66526% (Floater)		2.800.000,00		USD		4,6082 variabel	12.702,39	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 23.11.22/23.11.31 USD 3,509% (Zinssatz fest)		-2.800.000,00		USD		3,5090 fix		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPIRS147261	30.11.2028				
Floating Leg 30.11.22/30.11.28 USD 4,69012% (Floater)	3.500.000,00	USD	4,6346 variabel	41.514,24	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 30.11.22/30.11.28 USD 3,55% (Zinssatz fest)	-3.500.000,00	USD	3,5500 fix		
SWAPIRS147264	30.11.2032				
Floating Leg 30.11.22/30.11.32 USD 4,69012% (Floater)	500.000,00	USD	4,6346 variabel	5.748,29	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 30.11.22/30.11.32 USD 3,379% (Zinssatz fest)	-500.000,00	USD	3,3790 fix		
SWAPIRS147316	05.12.2027				
Floating Leg 05.12.22/05.12.27 USD 4,70845% (Floater)	6.000.000,00	USD	4,6541 variabel	105.493,83	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 05.12.22/05.12.27 USD 3,493% (Zinssatz fest)	-6.000.000,00	USD	3,4930 fix		
SWAPIRS147319	05.12.2030				
Floating Leg 05.12.22/05.12.30 USD 4,70845% (Floater)	1.500.000,00	USD	4,6541 variabel	27.092,50	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 05.12.22/05.12.30 USD 3,326% (Zinssatz fest)	-1.500.000,00	USD	3,3260 fix		
SWAPIRS147320	05.12.2028				
Floating Leg 05.12.22/05.12.28 USD 4,70845% (Floater)	4.600.000,00	USD	4,6541 variabel	82.673,14	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 05.12.22/05.12.28 USD 3,411% (Zinssatz fest)	-4.600.000,00	USD	3,4110 fix		
SWAPIRS147375	06.12.2028				
Floating Leg 06.12.22/06.12.28 USD 4,70845% (Floater)	4.500.000,00	USD	4,6541 variabel	96.194,88	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 06.12.22/06.12.28 USD 3,334% (Zinssatz fest)	-4.500.000,00	USD	3,3340 fix		
SWAPIRS148240	21.12.2030				
Floating Leg 21.12.22/21.12.30 USD 4,75978% (Floater)	3.000.000,00	USD	4,7087 variabel	61.770,98	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 21.12.22/21.12.30 USD 3,28% (Zinssatz fest)	-3.000.000,00	USD	3,2800 fix		
SWAPIRS148559	13.01.2030				
Floating Leg 13.01.23/13.01.30 USD 4,81225% (Floater)	1.900.000,00	USD	4,7632 variabel	40.460,03	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 13.01.23/13.01.30 USD 3,2939% (Zinssatz fest)	-1.900.000,00	USD	3,2939 fix		
SWAPIRS148561	13.01.2032				
Floating Leg 13.01.23/13.01.32 USD 4,81225% (Floater)	3.000.000,00	USD	4,7632 variabel	62.369,14	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 13.01.23/13.01.32 USD 3,26% (Zinssatz fest)	-3.000.000,00	USD	3,2600 fix		
SWAPIRS148685	20.01.2028				
Floating Leg 20.01.23/20.01.28 USD 4,83073% (Floater)	6.200.000,00	USD	4,7828 variabel	161.449,11	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 20.01.23/20.01.28 USD 3,2595% (Zinssatz fest)	-6.200.000,00	USD	3,2595 fix		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPIRS148687	20.01.2033				
Floating Leg 20.01.23/20.01.33 USD 4,83073% (Floater)	1.200.000,00	USD	4,7828 variabel	35.615,12	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 20.01.23/20.01.33 USD 3,128% (Zinssatz fest)	-1.200.000,00	USD	3,1280 fix		
SWAPIRS148688	20.01.2035				
Floating Leg 20.01.23/20.01.35 USD 4,83073% (Floater)	2.700.000,00	USD	4,7828 variabel	81.877,90	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 20.01.23/20.01.35 USD 3,136% (Zinssatz fest)	-2.700.000,00	USD	3,1360 fix		
SWAPIRS148822	31.01.2030				
Floating Leg 31.01.23/31.01.30 USD 4,86275% (Floater)	3.500.000,00	USD	4,8175 variabel	71.655,89	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 31.01.23/31.01.30 USD 3,309% (Zinssatz fest)	-3.500.000,00	USD	3,3090 fix		
SWAPIRS148823	31.01.2031				
Floating Leg 31.01.23/31.01.31 USD 4,86275% (Floater)	2.600.000,00	USD	4,8175 variabel	54.859,83	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 31.01.23/31.01.31 USD 3,271% (Zinssatz fest)	-2.600.000,00	USD	3,2710 fix		
SWAPIRS148824	31.01.2029				
Floating Leg 31.01.23/31.01.29 EUR 3,714% (Floater)	3.000.000,00	EUR	3,2420 variabel	51.576,11	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 31.01.23/31.01.29 EUR 2,801% (Zinssatz fest)	-3.000.000,00	EUR	2,8010 fix		
SWAPIRS148840	01.02.2029				
Floating Leg 01.02.23/01.02.29 USD 4,8658% (Floater)	2.700.000,00	USD	4,8208 variabel	51.852,19	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 01.02.23/01.02.29 USD 3,3755% (Zinssatz fest)	-2.700.000,00	USD	3,3755 fix		
SWAPIRS149167	09.02.2034				
Floating Leg 09.02.23/09.02.34 USD 4,88173% (Floater)	2.400.000,00	USD	4,8374 variabel	30.952,66	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 09.02.23/09.02.34 USD 3,346% (Zinssatz fest)	-2.400.000,00	USD	3,3460 fix		
SWAPIRS149168	09.02.2029				
Floating Leg 09.02.23/09.02.29 USD 4,88173% (Floater)	2.100.000,00	USD	4,8374 variabel	28.386,04	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 09.02.23/09.02.29 USD 3,499% (Zinssatz fest)	-2.100.000,00	USD	3,4990 fix		
SWAPIRS152258	17.04.2026				
Floating Leg 17.04.23/17.04.26 USD 5,02783% (Floater)	2.400.000,00	USD	5,0000 variabel	47.399,09	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 17.04.23/17.04.26 USD 3,589% (Zinssatz fest)	-2.400.000,00	USD	3,5890 fix		
SWAPIRS152260	17.04.2027				
Floating Leg 17.04.23/17.04.27 USD 5,02783% (Floater)	3.500.000,00	USD	5,0000 variabel	80.688,08	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 17.04.23/17.04.27 USD 3,379% (Zinssatz fest)	-3.500.000,00	USD	3,3790 fix		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPIRS152263	17.04.2033				
Floating Leg 17.04.23/17.04.33 USD 5,02783% (Floater)	2.100.000,00	USD	5,0000 variabel	61.817,47	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 17.04.23/17.04.33 USD 3,13% (Zinssatz fest)	-2.100.000,00	USD	3,1300 fix		
SWAPIRS152264	17.04.2029				
Floating Leg 17.04.23/17.04.29 USD 5,02783% (Floater)	3.800.000,00	USD	5,0000 variabel	102.106,02	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 17.04.23/17.04.29 USD 3,2% (Zinssatz fest)	-3.800.000,00	USD	3,2000 fix		
SWAPIRS153014	19.05.2032				
Floating Leg 19.05.23/19.05.32 USD 5,07365% (Floater)	1.800.000,00	USD	5,0556 variabel	40.655,14	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 19.05.23/19.05.32 USD 3,227% (Zinssatz fest)	-1.800.000,00	USD	3,2270 fix		
SWAPIRS153106	24.05.2033				
Floating Leg 24.05.23/24.05.33 USD 5,07536% (Floater)	2.700.000,00	USD	5,0563 variabel	19.582,73	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 24.05.23/24.05.33 USD 3,424% (Zinssatz fest)	-2.700.000,00	USD	3,4240 fix		
SWAPIRS153111	25.05.2030				
Floating Leg 25.05.23/25.05.30 USD 5,07574% (Floater)	3.700.000,00	USD	5,0564 variabel	36.840,43	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 25.05.23/25.05.30 USD 3,4825% (Zinssatz fest)	-3.700.000,00	USD	3,4825 fix		
SWAPIRS153337	07.06.2030				
Floating Leg 07.06.23/07.06.30 USD (Floater)	4.000.000,00	USD	variabel	18.444,04	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 07.06.23/07.06.30 USD 3,58% (Zinssatz fest)	-4.000.000,00	USD	3,5800 fix		
SWAPIRS153431	15.06.2028				
Floating Leg 15.06.23/15.06.28 USD (Floater)	6.500.000,00	USD	variabel	56.629,57	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 15.06.23/15.06.28 USD 3,6585% (Zinssatz fest)	-6.500.000,00	USD	3,6585 fix		
SWAPIRS153433	15.06.2033				
Floating Leg 15.06.23/15.06.33 USD (Floater)	600.000,00	USD	variabel	2.886,15	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 15.06.23/15.06.33 USD 3,454% (Zinssatz fest)	-600.000,00	USD	3,4540 fix		
SWAPIRS153435	15.06.2028				
Floating Leg 15.06.23/15.06.28 EUR 3,526% (Floater)	1.000.000,00	EUR	3,5260 variabel	8.001,05	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 15.06.23/15.06.28 EUR 3,02% (Zinssatz fest)	-1.000.000,00	EUR	3,0200 fix		
SWAPIRS153493	20.06.2033				
Floating Leg 20.06.23/20.06.33 USD (Floater)	2.250.000,00	USD	variabel	-6.674,22	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 20.06.23/20.06.33 USD 3,555% (Zinssatz fest)	-2.250.000,00	USD	3,5550 fix		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPIRS153494	20.06.2027				
Floating Leg 20.06.23/20.06.27 USD (Floater)	2.000.000,00	USD	variabel	12.557,13	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 20.06.23/20.06.27 USD 3,8625% (Zinssatz fest)	-2.000.000,00	USD	3,8625 fix		
SWAPIRS153542	22.06.2033				
Floating Leg 22.06.23/22.06.33 USD (Floater)	2.450.000,00	USD	variabel	10.838,70	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 22.06.23/22.06.33 USD 3,4583% (Zinssatz fest)	-2.450.000,00	USD	3,4583 fix		
SWAPIRS153563	23.06.2026				
Floating Leg 23.06.23/23.06.26 USD (Floater)	2.500.000,00	USD	variabel	7.726,60	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 23.06.23/23.06.26 USD 4,2132% (Zinssatz fest)	-2.500.000,00	USD	4,2132 fix		
SWAPIRS153654	28.06.2026				
Floating Leg 28.06.23/28.06.26 USD (Floater)	4.400.000,00	USD	variabel	19.282,24	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 28.06.23/28.06.26 USD 3,555% (Zinssatz fest)	-4.400.000,00	USD	3,5550 fix		
Zinsswaps gesamt				23.956.812,30	
Credit Default Swaps					
SWAPCDS030021926	20.12.2023				
CDS Reference Asset 20.03.14/20.12.23 EUR Commerzbank AG LT2 Nachr.MTN S.773 v.2011(19)	900.000,00	EUR		-17.870,79	Goldman Sachs International Limited London
CDS Gebührenleg 20.03.14/20.12.23 EUR 5%	-900.000,00	EUR	5,0000		
SWAPCDS030021945	20.12.2023				
CDS Reference Asset 20.06.19/20.12.23 EUR Commerzbank AG LT2 Nachr.MTN S.773 v.2011(19)	640.000,00	EUR		-12.708,12	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Gebührenleg 20.06.19/20.12.23 EUR 5%	-640.000,00	EUR	5,0000		
SWAPCDS030079606	20.12.2027				
CDS Reference Asset 20.06.19/20.12.27 USD Banque Centrale de Tunisie DL-Notes 1997(27)	4.000.000,00	USD		1.008.341,74	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Gebührenleg 20.06.19/20.12.27 USD 1%	-4.000.000,00	USD	1,0000		
SWAPCDS030079851	20.12.2027				
CDS Reference Asset 20.06.19/20.12.27 USD Banque Centrale de Tunisie DL-Notes 1997(27)	5.000.000,00	USD		1.260.427,17	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Gebührenleg 20.06.19/20.12.27 USD 1%	-5.000.000,00	USD	1,0000		
SWAPCDS030085311	20.06.2028				
CDS Reference Asset 20.06.19/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	154.000.000,00	JPY		68.864,69	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Gebührenleg 20.06.19/20.06.28 JPY 1%	-154.000.000,00	JPY	1,0000		

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS030085934 CDS Reference Asset 20.06.19/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44 CDS Gebührenleg 20.06.19/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 38.500.000,00 -38.500.000,00	JPY JPY	1,0000	17.216,17	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS030086871 CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44 CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 250.000.000,00 -250.000.000,00	JPY JPY	1,0000	111.793,33	Goldman Sachs International Limited London
SWAPCDS030086902 CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44 CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 250.000.000,00 -250.000.000,00	JPY JPY	1,0000	111.793,33	Goldman Sachs International Limited London
SWAPCDS030086903 CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44 CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 125.000.000,00 -125.000.000,00	JPY JPY	1,0000	55.896,67	Goldman Sachs International Limited London
SWAPCDS030087004 CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44 CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 250.000.000,00 -250.000.000,00	JPY JPY	1,0000	111.793,33	Goldman Sachs International Limited London
SWAPCDS030087008 CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44 CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 187.500.000,00 -187.500.000,00	JPY JPY	1,0000	83.845,00	Goldman Sachs International Limited London
SWAPCDS030087307 CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44 CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 218.750.000,00 -218.750.000,00	JPY JPY	1,0000	97.819,17	Goldman Sachs International Limited London
SWAPCDS030087308 CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44 CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 250.000.000,00 -250.000.000,00	JPY JPY	1,0000	111.793,33	Goldman Sachs International Limited London
SWAPCDS030087404 CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44 CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 263.200.000,00 -263.200.000,00	JPY JPY	1,0000	117.696,02	Goldman Sachs International Limited London
SWAPCDS030087652 CDS Reference Asset 20.06.18/20.12.23 EUR Commerzbank AG LT2 Nachr.MTN S.773 v.2011(19) CDS Gebührenleg 20.06.18/20.12.23 EUR 5%	20.12.2023 900.000,00 -900.000,00	EUR EUR	5,0000	-17.870,79	JP Morgan Securities plc (OTC) London

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS030087653	20.12.2023				
CDS Reference Asset 20.06.19/20.12.23 EUR Commerzbank AG LT2 Nachr.MTN S.773 v.2011(19)	620.000,00	EUR		-12.310,99	
CDS Gebührenleg 20.06.19/20.12.23 EUR 5%	-620.000,00	EUR	5,0000		Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS030087814	20.06.2028				
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	200.000.000,00	JPY		89.434,67	
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-200.000.000,00	JPY	1,0000		Goldman Sachs International Limited London
SWAPCDS030087815	20.06.2028				
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	327.500.000,00	JPY		146.449,27	
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-327.500.000,00	JPY	1,0000		Goldman Sachs International Limited London
SWAPCDS030087832	20.06.2028				
CDS Reference Asset 20.06.18/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	196.500.000,00	JPY		87.869,56	
CDS Gebührenleg 20.06.18/20.06.28 JPY 1%	-196.500.000,00	JPY	1,0000		Goldman Sachs International Limited London
SWAPCDS030088624	20.06.2028				
CDS Reference Asset 20.06.19/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44	127.500.000,00	JPY		57.014,60	
CDS Gebührenleg 20.06.19/20.06.28 JPY 1%	-127.500.000,00	JPY	1,0000		Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS107143	20.06.2026				
CDS Reference Asset 20.09.19/20.06.26 USD Boyd Gaming Corp. DL-Notes 2015(15/23)	3.150.000,00	USD		-345.753,89	
CDS Gebührenleg 20.09.19/20.06.26 USD 5%	-3.150.000,00	USD	5,0000		Credit Suisse International London
SWAPCDS107566	20.06.2026				
CDS Reference Asset 20.09.19/20.06.26 USD Boyd Gaming Corp. DL-Notes 2015(15/23)	1.800.000,00	USD		-197.573,65	
CDS Gebührenleg 20.09.19/20.06.26 USD 5%	-1.800.000,00	USD	5,0000		Credit Suisse International London
SWAPCDS108038	20.06.2026				
CDS Reference Asset 20.09.19/20.06.26 USD Boyd Gaming Corp. DL-Notes 2015(15/23)	2.250.000,00	USD		-246.967,07	
CDS Gebührenleg 20.09.19/20.06.26 USD 5%	-2.250.000,00	USD	5,0000		Credit Suisse International London
SWAPCDS108303	20.12.2024				
CDS Reference Asset 20.09.19/20.12.24 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2013(13/23)	7.000.000,00	USD		-38.178,95	
CDS Gebührenleg 20.09.19/20.12.24 USD 1%	-7.000.000,00	USD	1,0000		BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS108316	20.12.2023				
CDS Reference Asset 20.09.19/20.12.23 EUR Commerzbank AG LT2 Nachr.MTN S.773 v.2011(19)	900.000,00	EUR		-17.870,79	
CDS Gebührenleg 20.09.19/20.12.23 EUR 5%	-900.000,00	EUR	5,0000		Goldman Sachs International Limited London

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS108365 CDS Reference Asset 20.09.19/20.12.24 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 20.09.19/20.12.24 USD 1%	20.12.2024 2.150.000,00 -2.150.000,00	USD USD	1,0000	-11.726,39	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS110825 CDS Reference Asset 20.12.19/20.12.24 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 20.12.19/20.12.24 USD 1%	20.12.2024 2.400.000,00 -2.400.000,00	USD USD	1,0000	-13.089,92	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS113619 CDS Reference Asset 20.03.20/20.12.25 USD Pactiv LLC DL-Notes 1999(25) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.12.25 USD 5%	20.12.2025 5.000.000,00 -5.000.000,00	USD USD	5,0000	-434.892,21	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS113620 CDS Reference Asset 20.03.20/20.12.25 USD Pactiv LLC DL-Notes 1999(25) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.12.25 USD 5%	20.12.2025 500.000,00 -500.000,00	USD USD	5,0000	-43.489,22	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS114063 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Amkor Technology Inc. DL-Notes 2019(19/27) 144A CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 1.000.000,00 -1.000.000,00	USD USD	5,0000	-76.005,16	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS114085 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Amkor Technology Inc. DL-Notes 2019(19/27) 144A CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 1.000.000,00 -1.000.000,00	USD USD	5,0000	-76.005,16	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS114086 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Amkor Technology Inc. DL-Notes 2019(19/27) 144A CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 1.000.000,00 -1.000.000,00	USD USD	5,0000	-76.005,16	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS114088 CDS Reference Asset 20.03.20/20.12.24 USD Howmet Aerospace Inc. DL-Notes 2014(14/24) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.12.24 USD 5%	20.12.2024 6.300.000,00 -6.300.000,00	USD USD	5,0000	-389.494,20	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS114404 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Level 3 Financing Inc. DL-Notes 2015(15/22) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 2.550.000,00 -2.550.000,00	USD USD	5,0000	-204.170,73	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS114417 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Transdigm Inc. DL-Notes 2014(14/24) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 2.300.000,00 -2.300.000,00	USD USD	5,0000	-163.580,54	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS114451 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Avient Corp. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 1.800.000,00 -1.800.000,00	USD USD	5,0000	-132.934,21	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS114479 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Avient Corp. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 1.800.000,00 -1.800.000,00	USD USD	5,0000	-132.934,21	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS114481 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Targa Resources Part.L.P./Fin. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 2.000.000,00 -2.000.000,00	USD USD	5,0000	-152.746,47	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfu
SWAPCDS114482 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Targa Resources Part.L.P./Fin. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 3.000.000,00 -3.000.000,00	USD USD	5,0000	-229.119,71	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfu
SWAPCDS114602 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Avient Corp. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 6.300.000,00 -6.300.000,00	USD USD	5,0000	-465.269,74	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS114712 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.27 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.27 USD 1%	20.06.2027 2.800.000,00 -2.800.000,00	USD USD	1,0000	134.760,52	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS114748 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Aramark Services Inc. DL-Notes 2017(17/26) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 2.850.000,00 -2.850.000,00	USD USD	5,0000	-211.902,34	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS114761 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Avient Corp. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 2.925.000,00 -2.925.000,00	USD USD	5,0000	-216.018,09	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS115042 CDS Reference Asset 20.03.20/20.03.25 USD Radian Group Inc. DL-Notes 2017(17/24) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.03.25 USD 5%	20.03.2025 2.910.000,00 -2.910.000,00	USD USD	5,0000	-185.588,92	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS115060 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Aramark Services Inc. DL-Notes 2017(17/26) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 2.850.000,00 -2.850.000,00	USD USD	5,0000	-211.902,34	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS115061 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Aramark Services Inc. DL-Notes 2017(17/26) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 1.900.000,00 -1.900.000,00	USD USD	5,0000	-141.268,22	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS115079 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Aramark Services Inc. DL-Notes 2017(17/26) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 900.000,00 -900.000,00	USD USD	5,0000	-66.916,53	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS115219 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Avient Corp. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 2.475.000,00 -2.475.000,00	USD USD	5,0000	-182.784,54	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS115281 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Olin Corp. DL-Notes 2012(12/22) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 2.500.000,00 -2.500.000,00	USD USD	5,0000	-176.619,57	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS115559 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Aramark Services Inc. DL-Notes 2017(17/26) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 2.850.000,00 -2.850.000,00	USD USD	5,0000	-211.902,34	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS115581 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Aramark Services Inc. DL-Notes 2017(17/26) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 2.850.000,00 -2.850.000,00	USD USD	5,0000	-211.902,34	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS116343 CDS Reference Asset 22.06.20/20.09.29 USD New Albertsons L.P. DL-Notes 2001(01/31) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.09.29 USD 5%	20.09.2029 3.500.000,00 -3.500.000,00	USD USD	5,0000	-586.643,40	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS116345 CDS Reference Asset 22.06.20/20.09.27 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.09.27 USD 5%	20.09.2027 1.500.000,00 -1.500.000,00	USD USD	5,0000	-220.469,91	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS116932 CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Ovintiv Inc. DL-Notes 2015(15/26) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 1%	20.03.2026 5.150.000,00 -5.150.000,00	USD USD	1,0000	-65.388,25	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS116956 CDS Reference Asset 22.06.20/20.06.25 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44 CDS Gebührenleg 22.06.20/20.06.25 JPY 1%	20.06.2025 836.350.000,00 -836.350.000,00	JPY JPY	1,0000	53.048,54	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS116957 CDS Reference Asset 22.06.20/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2013(20) No. 44 CDS Gebührenleg 22.06.20/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 673.800.000,00 -673.800.000,00	JPY JPY	1,0000	301.305,40	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS117324 CDS Reference Asset 22.06.20/20.06.25 USD Expedia Group Inc. DL-Notes 2014(14/24) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.06.25 USD 1%	20.06.2025 3.150.000,00 -3.150.000,00	USD USD	1,0000	-33.608,16	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS118127 CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Ovintiv Inc. DL-Notes 2015(15/26) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	20.03.2026 3.000.000,00 -3.000.000,00	USD USD	5,0000	-317.833,72	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS118142 CDS Reference Asset 22.06.20/20.09.23 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.09.23 USD 5%	20.09.2023 3.100.000,00 -3.100.000,00	USD USD	5,0000	-30.504,37	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS118338 CDS Reference Asset 22.06.20/20.09.23 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.09.23 USD 5%	20.09.2023 6.900.000,00 -6.900.000,00	USD USD	5,0000	-67.896,82	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS118349 CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	20.03.2026 1.900.000,00 -1.900.000,00	USD USD	5,0000	-202.129,31	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS118352 CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	20.03.2026 1.900.000,00 -1.900.000,00	USD USD	5,0000	-202.129,31	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS118648 CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	20.03.2026 1.900.000,00 -1.900.000,00	USD USD	5,0000	-202.129,31	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS118649 CDS Reference Asset 22.06.20/20.03.26 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.03.26 USD 5%	20.03.2026 2.850.000,00 -2.850.000,00	USD USD	5,0000	-303.193,97	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS118820 CDS Reference Asset 22.06.20/20.06.25 USD Expedia Group Inc. DL-Notes 2014(14/24) CDS Gebührenleg 22.06.20/20.06.25 USD 1%	20.06.2025 1.450.000,00 -1.450.000,00	USD USD	1,0000	-15.470,42	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS119429 CDS Reference Asset 21.09.20/20.03.26 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22) CDS Gebührenleg 21.09.20/20.03.26 USD 5%	20.03.2026 5.000.000,00 -5.000.000,00	USD USD	5,0000	-497.820,96	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS120308 CDS Reference Asset 21.09.20/20.12.25 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 21.09.20/20.12.25 USD 1%	20.12.2025 1.700.000,00 -1.700.000,00	USD USD	1,0000	16.152,01	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS120316 CDS Reference Asset 21.09.20/20.12.23 USD Olin Corp. DL-Notes 2012(12/22) CDS Gebührenleg 21.09.20/20.12.23 USD 5%	20.12.2023 250.000,00 -250.000,00	USD USD	5,0000	-5.230,24	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS120317 CDS Reference Asset 21.09.20/20.06.25 USD Olin Corp. DL-Notes 2012(12/22) CDS Gebührenleg 21.09.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 5.000.000,00 -5.000.000,00	USD USD	5,0000	-353.239,14	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS120903 CDS Reference Asset 21.09.20/20.12.25 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 21.09.20/20.12.25 USD 1%	20.12.2025 1.100.000,00 -1.100.000,00	USD USD	1,0000	10.451,30	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS120904 CDS Reference Asset 21.09.20/20.09.23 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22) CDS Gebührenleg 21.09.20/20.09.23 USD 5%	20.09.2023 500.000,00 -500.000,00	USD USD	5,0000	-4.920,06	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS120906 CDS Reference Asset 21.09.20/20.03.26 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22) CDS Gebührenleg 21.09.20/20.03.26 USD 5%	20.03.2026 350.000,00 -350.000,00	USD USD	5,0000	-34.847,47	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS121519 CDS Reference Asset 21.12.20/20.03.25 USD Radian Group Inc. DL-Notes 2017(17/24) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.03.25 USD 5%	20.03.2025 1.230.000,00 -1.230.000,00	USD USD	5,0000	-78.444,80	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS121521 CDS Reference Asset 21.12.20/20.03.26 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.03.26 USD 5%	20.03.2026 2.000.000,00 -2.000.000,00	USD USD	5,0000	-199.128,39	Credit Suisse International London
SWAPCDS121540 CDS Reference Asset 21.12.20/20.09.23 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.09.23 USD 5%	20.09.2023 5.500.000,00 -5.500.000,00	USD USD	5,0000	-54.120,65	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS121556 CDS Reference Asset 21.12.20/20.09.23 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.09.23 USD 5%	20.09.2023 3.500.000,00 -3.500.000,00	USD USD	5,0000	-34.440,42	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS123130 CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.23 USD 5% CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.23 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29)	20.12.2023 294.000,00 -294.000,00	USD USD	5,0000	-37.735,04	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123131 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.25 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.25 USD 5%	20.12.2025 504.000,00 -504.000,00	USD USD	5,0000	254.737,94	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123132 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.26 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.26 USD 5%	20.12.2026 462.000,00 -462.000,00	USD USD	5,0000	264.388,44	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123133 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.27 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.27 USD 5%	20.12.2027 546.000,00 -546.000,00	USD USD	5,0000	324.771,97	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123134 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.28 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.28 USD 5%	20.12.2028 588.000,00 -588.000,00	USD USD	5,0000	355.969,96	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123135 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.29 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.29 USD 5%	20.12.2029 672.000,00 -672.000,00	USD USD	5,0000	415.257,95	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123136 CDS Reference Asset 21.12.20/20.09.30 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.09.30 USD 5%	20.09.2030 336.000,00 -336.000,00	USD USD	5,0000	209.595,09	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123540 CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.23 USD 5% CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.23 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29)	20.12.2023 96.000,00 -96.000,00	USD USD	5,0000	-12.321,64	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123541 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.25 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.25 USD 5%	20.12.2025 288.000,00 -288.000,00	USD USD	5,0000	145.564,54	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS123542 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.26 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.26 USD 5%	20.12.2026 264.000,00 -264.000,00	USD USD	5,0000	151.079,11	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123543 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.27 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.27 USD 5%	20.12.2027 312.000,00 -312.000,00	USD USD	5,0000	185.583,98	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123544 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.28 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.28 USD 5%	20.12.2028 336.000,00 -336.000,00	USD USD	5,0000	203.411,41	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123545 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.29 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.29 USD 5%	20.12.2029 384.000,00 -384.000,00	USD USD	5,0000	237.290,26	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123546 CDS Reference Asset 21.12.20/20.09.30 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.09.30 USD 5%	20.09.2030 192.000,00 -192.000,00	USD USD	5,0000	119.768,62	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123580 CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.23 USD 5% CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.23 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29)	20.12.2023 96.000,00 -96.000,00	USD USD	5,0000	-12.321,64	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123581 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.25 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.25 USD 5%	20.12.2025 288.000,00 -288.000,00	USD USD	5,0000	145.564,54	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123582 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.26 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.26 USD 5%	20.12.2026 264.000,00 -264.000,00	USD USD	5,0000	151.079,11	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123583 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.27 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.27 USD 5%	20.12.2027 288.000,00 -288.000,00	USD USD	5,0000	171.308,29	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123584 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.28 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.28 USD 5%	20.12.2028 336.000,00 -336.000,00	USD USD	5,0000	203.411,41	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS123585 CDS Reference Asset 21.12.20/20.12.29 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.12.29 USD 5%	20.12.2029 384.000,00 -384.000,00	USD USD	5,0000	237.290,26	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS123586 CDS Reference Asset 21.12.20/20.09.30 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 21.12.20/20.09.30 USD 5%	20.09.2030 192.000,00 -192.000,00	USD USD	5,0000	119.768,62	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS126686 CDS Reference Asset 22.03.21/20.06.25 USD Targa Resources Part.L.P./Fin. DL-Notes 2013(13/23) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 3.000.000,00 -3.000.000,00	USD USD	5,0000	-229.119,71	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS126818 CDS Reference Asset 22.03.21/20.06.25 USD Transdigm Inc. DL-Notes 2017(17/26) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 1.450.000,00 -1.450.000,00	USD USD	5,0000	-103.126,86	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS127162 CDS Reference Asset 22.03.21/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.03.26 USD 1%	20.03.2026 5.300.000,00 -5.300.000,00	USD USD	1,0000	296.472,67	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS127313 CDS Reference Asset 22.03.21/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.03.26 USD 1%	20.03.2026 1.930.000,00 -1.930.000,00	USD USD	1,0000	107.960,80	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS127442 CDS Gebührenleg 22.03.21/20.06.24 USD 5% CDS Reference Asset 22.03.21/20.06.24 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29)	20.06.2024 72.000,00 -72.000,00	USD USD	5,0000	-13.861,27	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS127443 CDS Reference Asset 22.03.21/20.06.25 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 168.000,00 -168.000,00	USD USD	5,0000	75.463,33	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS127444 CDS Reference Asset 22.03.21/20.06.26 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.06.26 USD 5%	20.06.2026 264.000,00 -264.000,00	USD USD	5,0000	145.205,45	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS127445 CDS Reference Asset 22.03.21/20.06.27 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.06.27 USD 5%	20.06.2027 288.000,00 -288.000,00	USD USD	5,0000	170.286,04	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS127446 CDS Reference Asset 22.03.21/20.06.28 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.06.28 USD 5%	20.06.2028 312.000,00 -312.000,00	USD USD	5,0000	186.621,57	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS127447 CDS Reference Asset 22.03.21/20.06.29 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.06.29 USD 5%	20.06.2029 360.000,00 -360.000,00	USD USD	5,0000	220.301,00	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS127448 CDS Reference Asset 22.03.21/20.09.30 USD Argentinien, Republik DL-Bonds 2020(20/25-29) CDS Gebührenleg 22.03.21/20.09.30 USD 5%	20.09.2030 384.000,00 -384.000,00	USD USD	5,0000	239.537,25	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS128121 CDS Reference Asset 21.06.21/20.06.26 USD MGIC Investment Corp. DL-Notes 2016(16/23) CDS Gebührenleg 21.06.21/20.06.26 USD 5%	20.06.2026 4.300.000,00 -4.300.000,00	USD USD	5,0000	-470.118,73	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS128905 CDS Reference Asset 21.06.21/20.03.27 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) CDS Gebührenleg 21.06.21/20.03.27 JPY 1%	20.03.2027 572.000.000,00 -572.000.000,00	JPY JPY	1,0000	143.129,80	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS129687 CDS Reference Asset 20.09.21/20.03.27 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) CDS Gebührenleg 20.09.21/20.03.27 JPY 1%	20.03.2027 546.400.000,00 -546.400.000,00	JPY JPY	1,0000	136.723,99	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS129997 CDS Reference Asset 20.09.21/20.03.27 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) CDS Gebührenleg 20.09.21/20.03.27 JPY 1%	20.03.2027 270.000.000,00 -270.000.000,00	JPY JPY	1,0000	67.561,27	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS130702 CDS Reference Asset 20.09.21/20.12.26 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A CDS Gebührenleg 20.09.21/20.12.26 USD 5%	20.12.2026 2.700.000,00 -2.700.000,00	USD USD	5,0000	-296.099,22	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS131825 CDS Reference Asset 20.09.21/20.12.26 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) CDS Gebührenleg 20.09.21/20.12.26 JPY 1%	20.12.2026 67.500.000,00 -67.500.000,00	JPY JPY	1,0000	14.532,15	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS132242 CDS Reference Asset 20.09.21/20.09.23 EUR Ladbroses Group Finance PLC LS-Notes 2014(22) CDS Gebührenleg 20.09.21/20.09.23 EUR 1%	20.09.2023 2.170.000,00 -2.170.000,00	EUR EUR	1,0000	-3.915,65	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS132243 CDS Reference Asset 20.09.21/20.09.23 EUR Ladbrokes Group Finance PLC LS-Notes 2014(22) CDS Gebührenleg 20.09.21/20.09.23 EUR 1%	20.09.2023 490.000,00 -490.000,00	EUR EUR	1,0000	-884,18	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid
SWAPCDS133217 CDS Reference Asset 20.12.21/20.12.26 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) CDS Gebührenleg 20.12.21/20.12.26 JPY 1%	20.12.2026 158.000.000,00 -158.000.000,00	JPY JPY	1,0000	34.016,00	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS133335 CDS Reference Asset 20.12.21/20.03.24 EUR Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S CDS Gebührenleg 20.12.21/20.03.24 EUR 5%	20.03.2024 3.000.000,00 -3.000.000,00	EUR EUR	5,0000	-85.173,72	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS133336 CDS Reference Asset 20.12.21/20.03.24 EUR Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S CDS Gebührenleg 20.12.21/20.03.24 EUR 5%	20.03.2024 355.000,00 -355.000,00	EUR EUR	5,0000	-10.078,89	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS133520 CDS Reference Asset 20.12.21/20.03.24 EUR Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S CDS Gebührenleg 20.12.21/20.03.24 EUR 5%	20.03.2024 355.000,00 -355.000,00	EUR EUR	5,0000	-10.078,89	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS133977 CDS Reference Asset 20.12.21/20.03.26 USD T-Mobile USA Inc. DL-Notes 2017(17/22) CDS Gebührenleg 20.12.21/20.03.26 USD 5%	20.03.2026 1.000.000,00 -1.000.000,00	USD USD	5,0000	-99.564,19	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS134282 CDS Reference Asset 20.12.21/20.09.23 EUR Ladbrokes Group Finance PLC LS-Notes 2014(22) CDS Gebührenleg 20.12.21/20.09.23 EUR 1%	20.09.2023 3.800.000,00 -3.800.000,00	EUR EUR	1,0000	-6.856,90	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid
SWAPCDS135092 CDS Reference Asset 21.03.22/20.06.27 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2018(18/28) CDS Gebührenleg 21.03.22/20.06.27 USD 1%	20.06.2027 3.200.000,00 -3.200.000,00	USD USD	1,0000	154.012,02	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS135208 CDS Reference Asset 21.03.22/20.09.25 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26) CDS Gebührenleg 21.03.22/20.09.25 USD 1%	20.09.2025 1.470.000,00 -1.470.000,00	USD USD	1,0000	-5.878,54	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS136142 CDS Reference Asset 21.03.22/20.06.25 USD Aramark Services Inc. DL-Notes 2020(20/25) 144A CDS Gebührenleg 21.03.22/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 800.000,00 -800.000,00	USD USD	5,0000	-59.481,36	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfu

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS136159 CDS Reference Asset 21.03.22/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28) CDS Gebührenleg 21.03.22/20.03.26 USD 1%	20.03.2026 3.850.000,00 -3.850.000,00	USD USD	1,0000	215.362,23	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS136174 CDS Reference Asset 21.03.22/20.06.27 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26) CDS Gebührenleg 21.03.22/20.06.27 USD 1%	20.06.2027 2.000.000,00 -2.000.000,00	USD USD	1,0000	87.090,77	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid
SWAPCDS136592 CDS Reference Asset 21.03.22/20.06.27 EUR Verisure Midholding AB EO-Notes 2021(21/29) Reg.S CDS Gebührenleg 21.03.22/20.06.27 EUR 5%	20.06.2027 3.500.000,00 -3.500.000,00	EUR EUR	5,0000	-106.943,35	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS136630 CDS Reference Asset 21.03.22/20.06.27 EUR Verisure Midholding AB EO-Notes 2021(21/29) Reg.S CDS Gebührenleg 21.03.22/20.06.27 EUR 5%	20.06.2027 2.500.000,00 -2.500.000,00	EUR EUR	5,0000	-76.388,11	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS139737 CDS Reference Asset 21.03.22/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28) CDS Gebührenleg 21.03.22/20.03.26 USD 1%	20.03.2026 3.500.000,00 -3.500.000,00	USD USD	1,0000	195.783,84	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS140210 CDS Reference Asset 20.06.22/20.03.25 EUR Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S CDS Gebührenleg 20.06.22/20.03.25 EUR 5%	20.03.2025 900.000,00 -900.000,00	EUR EUR	5,0000	-41.866,38	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS140336 CDS Reference Asset 21.06.22/20.03.25 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26) CDS Gebührenleg 21.06.22/20.03.25 USD 1%	20.03.2025 2.220.000,00 -2.220.000,00	USD USD	1,0000	-22.037,44	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS140658 CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.25 USD Aramark Services Inc. DL-Notes 2020(20/25) 144A CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 1.000.000,00 -1.000.000,00	USD USD	5,0000	-74.351,70	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS140783 CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.25 USD Aramark Services Inc. DL-Notes 2020(20/25) 144A CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 760.000,00 -760.000,00	USD USD	5,0000	-56.507,29	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS142219 CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.27 USD Netflix Inc. DL-Notes 2019(19/30) 144A CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.27 USD 5%	20.06.2027 1.000.000,00 -1.000.000,00	USD USD	5,0000	-142.554,94	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS143110 CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.26 USD Amkor Technology Inc. DL-Notes 2019(19/27) 144A CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.26 USD 5%	20.06.2026 975.000,00 -975.000,00	USD USD	5,0000	-101.654,84	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS143163 CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.27 USD MGIC Investment Corp. DL-Notes 2020(20/28) CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.27 USD 5%	20.06.2027 1.520.000,00 -1.520.000,00	USD USD	5,0000	-201.232,07	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS143172 CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.27 USD MGIC Investment Corp. DL-Notes 2020(20/28) CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.27 USD 5%	20.06.2027 1.610.000,00 -1.610.000,00	USD USD	5,0000	-213.147,13	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS143420 CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.27 USD Unisys Corp. DL-Notes 2020(20/27) 144A CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.27 USD 5%	20.06.2027 2.950.000,00 -2.950.000,00	USD USD	5,0000	331.311,75	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS143622 CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.27 USD Unisys Corp. DL-Notes 2020(20/27) 144A CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.27 USD 5%	20.06.2027 1.000.000,00 -1.000.000,00	USD USD	5,0000	112.309,07	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS145378 CDS Reference Asset 20.09.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 4.230.000,00 -4.230.000,00	EUR EUR	1,0000	-34.895,01	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS145404 CDS Reference Asset 20.09.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 2.120.000,00 -2.120.000,00	EUR EUR	1,0000	-17.488,75	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS145428 CDS Reference Asset 20.09.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 2.820.000,00 -2.820.000,00	EUR EUR	1,0000	-23.263,34	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS145517 CDS Reference Asset 20.09.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 2.790.000,00 -2.790.000,00	EUR EUR	1,0000	-23.015,86	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS145535 CDS Reference Asset 20.09.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 1.380.000,00 -1.380.000,00	EUR EUR	1,0000	-11.384,19	J.P. Morgan SE Frankfurt

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS145536 CDS Reference Asset 20.09.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 1.100.000,00 -1.100.000,00	EUR EUR	1,0000	-9.074,35	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS146073 CDS Reference Asset 20.09.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 2.820.000,00 -2.820.000,00	EUR EUR	1,0000	-23.263,34	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS146113 CDS Reference Asset 20.09.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 940.000,00 -940.000,00	EUR EUR	1,0000	-7.754,45	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS146114 CDS Reference Asset 20.09.22/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.09.25 EUR 5%	20.09.2025 1.100.000,00 -1.100.000,00	EUR EUR	5,0000	7.160,49	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS146115 CDS Reference Asset 20.09.22/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.09.25 EUR 5%	20.09.2025 1.100.000,00 -1.100.000,00	EUR EUR	5,0000	7.160,49	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS146224 CDS Reference Asset 20.09.22/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.09.25 EUR 5%	20.09.2025 4.750.000,00 -4.750.000,00	EUR EUR	5,0000	30.920,29	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid
SWAPCDS146751 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 300.000,00 -300.000,00	EUR EUR	1,0000	27,38	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146752 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 1.200.000,00 -1.200.000,00	EUR EUR	1,0000	17.238,86	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfu
SWAPCDS146753 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 1.200.000,00 -1.200.000,00	EUR EUR	1,0000	17.238,86	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146754 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 300.000,00 -300.000,00	EUR EUR	1,0000	10.013,74	Deutsche Bank AG Frankfurt

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS146755 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	20.12.2032 3.600.000,00 -3.600.000,00	EUR EUR	1,0000	217.368,68	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS146756 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	20.12.2032 3.400.000,00 -3.400.000,00	EUR EUR	1,0000	205.292,64	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfu
SWAPCDS146757 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	20.12.2032 1.700.000,00 -1.700.000,00	EUR EUR	1,0000	102.646,32	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146759 CDS Reference Asset 20.09.22/20.09.25 USD Teva Pharmac.Fin.NL III B.V. DL-Notes 2016(16/26) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.09.25 USD 1%	20.09.2025 660.000,00 -660.000,00	USD USD	1,0000	-2.639,34	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfu
SWAPCDS146799 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 750.000,00 -750.000,00	EUR EUR	1,0000	68,46	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146800 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 750.000,00 -750.000,00	EUR EUR	1,0000	10.774,29	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146801 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 750.000,00 -750.000,00	EUR EUR	1,0000	25.034,35	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146902 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	20.12.2032 4.250.000,00 -4.250.000,00	EUR EUR	1,0000	256.615,80	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146903 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 500.000,00 -500.000,00	EUR EUR	1,0000	-6.315,13	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146904 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 500.000,00 -500.000,00	EUR EUR	1,0000	-5.188,06	Deutsche Bank AG Frankfurt

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS146905 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.28 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.28 EUR 1%	20.12.2028 3.600.000,00 -3.600.000,00	EUR EUR	1,0000	-20.922,33	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS147105 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 1.080.000,00 -1.080.000,00	EUR EUR	1,0000	8.951,34	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS147106 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 1.825.000,00 -1.825.000,00	EUR EUR	1,0000	22.740,75	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS147107 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 1.460.000,00 -1.460.000,00	EUR EUR	1,0000	18.192,60	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS147108 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 1.460.000,00 -1.460.000,00	EUR EUR	1,0000	18.192,60	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS147134 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR TK Elevator Holdco GmbH Anleihe v.20(20/28) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 5%	20.12.2027 4.500.000,00 -4.500.000,00	EUR EUR	5,0000	-194.011,97	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid
SWAPCDS147219 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 6.500.000,00 -6.500.000,00	EUR EUR	1,0000	-41.404,29	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS147247 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.30 EUR DEUTSCHE BANK AKTIENGESELLSCHAFT Ref ID: XSLACREF CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.30 EUR 1%	20.12.2030 2.190.000,00 -2.190.000,00	EUR EUR	1,0000	90.971,65	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS147254 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.30 EUR DEUTSCHE BANK AKTIENGESELLSCHAFT Ref ID: XSLACREF CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.30 EUR 1%	20.12.2030 1.500.000,00 -1.500.000,00	EUR EUR	1,0000	62.309,35	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS147257 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Verisure Midholding AB EO-Notes 2021(21/29) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 5%	20.12.2027 1.800.000,00 -1.800.000,00	EUR EUR	5,0000	-39.227,09	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS147271 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR INTESA SANPAOLO SPA SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 2.400.000,00 -2.400.000,00	EUR EUR	1,0000	19.891,87	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS147292 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 5.440.000,00 -5.440.000,00	EUR EUR	1,0000	-70.256,97	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS147365 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Barclays PLC EO-FLR Med.-Term Nts 18(18/26) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 860.000,00 -860.000,00	EUR EUR	1,0000	-3.102,33	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS147366 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Barclays PLC EO-FLR Med.-Term Nts 18(18/26) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 3.610.000,00 -3.610.000,00	EUR EUR	1,0000	17.118,35	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS147367 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Barclays PLC EO-FLR Med.-Term Nts 18(18/26) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 1.820.000,00 -1.820.000,00	EUR EUR	1,0000	8.630,30	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS148200 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 JPY 1%	20.12.2029 260.000.000,00 -260.000.000,00	JPY JPY	1,0000	60.949,10	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS148225 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 JPY 1%	20.12.2029 244.000.000,00 -244.000.000,00	JPY JPY	1,0000	57.198,39	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS148445 CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.28 EUR Societe Generale SRO LAC CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.28 EUR 1%	20.06.2028 2.000.000,00 -2.000.000,00	EUR EUR	1,0000	4.482,12	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS148523 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 750.000,00 -750.000,00	EUR EUR	1,0000	68,46	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148524 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 750.000,00 -750.000,00	EUR EUR	1,0000	10.774,29	Deutsche Bank AG Frankfurt

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS148525 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 750.000,00 -750.000,00	EUR EUR	1,0000	25.034,35	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148526 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.32 EUR 1%	20.12.2032 4.250.000,00 -4.250.000,00	EUR EUR	1,0000	256.615,80	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148527 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 JPY 1%	20.12.2027 110.000.000,00 -110.000.000,00	JPY JPY	1,0000	10.181,06	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfu
SWAPCDS148557 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 940.000,00 -940.000,00	EUR EUR	1,0000	-7.754,45	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148597 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 1.600.000,00 -1.600.000,00	EUR EUR	1,0000	-13.199,06	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148598 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SUB CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 100.000,00 -100.000,00	EUR EUR	1,0000	-605,88	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148599 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SUB CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 100.000,00 -100.000,00	EUR EUR	1,0000	526,91	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148600 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SUB CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 100.000,00 -100.000,00	EUR EUR	1,0000	2.045,28	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148601 CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.32 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SUB CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 800.000,00 -800.000,00	EUR EUR	1,0000	34.614,94	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148629 CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.26 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBLO CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.26 EUR 1%	20.06.2026 2.500.000,00 -2.500.000,00	EUR EUR	1,0000	-20.965,49	Deutsche Bank AG Frankfurt

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS148643 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 2.000.000,00 -2.000.000,00	EUR EUR	1,0000	-16.498,82	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS148690 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 USD Bath & Body Works Inc. DL-Notes 2018(18/28) CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 USD 1%	20.12.2027 2.400.000,00 -2.400.000,00	USD USD	1,0000	149.551,77	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfu
SWAPCDS148724 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 JPY 1%	20.12.2027 69.000.000,00 -69.000.000,00	JPY JPY	1,0000	6.386,30	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfu
SWAPCDS148725 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 JPY 1%	20.12.2029 304.000.000,00 -304.000.000,00	JPY JPY	1,0000	71.263,57	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfu
SWAPCDS148726 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 280.000,00 -280.000,00	EUR EUR	1,0000	-3.536,47	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS148727 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 1.940.000,00 -1.940.000,00	EUR EUR	1,0000	-20.129,66	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS148742 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 JPY 1%	20.12.2025 39.000.000,00 -39.000.000,00	JPY JPY	1,0000	-1.157,08	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfu
SWAPCDS148743 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 JPY 1%	20.12.2027 27.000.000,00 -27.000.000,00	JPY JPY	1,0000	2.498,99	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfu
SWAPCDS148744 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 JPY 1%	20.12.2029 293.000.000,00 -293.000.000,00	JPY JPY	1,0000	68.684,95	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfu
SWAPCDS148808 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 JPY 1%	20.12.2025 39.000.000,00 -39.000.000,00	JPY JPY	1,0000	-1.157,08	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS148809 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 JPY 1%	20.12.2027 27.000.000,00 -27.000.000,00	JPY JPY	1,0000	2.498,99	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS148810 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 JPY 1%	20.12.2029 293.000.000,00 -293.000.000,00	JPY JPY	1,0000	68.684,95	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS148820 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 JPY 1%	20.12.2025 68.000.000,00 -68.000.000,00	JPY JPY	1,0000	-2.017,48	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS148821 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 JPY 1%	20.12.2029 293.000.000,00 -293.000.000,00	JPY JPY	1,0000	68.684,95	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS148835 CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.25 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.25 EUR 1%	20.06.2025 3.000.000,00 -3.000.000,00	EUR EUR	1,0000	-22.492,64	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS149153 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 JPY 1%	20.12.2029 145.000.000,00 -145.000.000,00	JPY JPY	1,0000	33.990,85	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS149165 CDS Reference Asset 20.12.22/20.09.30 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.09.30 JPY 1%	20.09.2030 153.000.000,00 -153.000.000,00	JPY JPY	1,0000	42.987,06	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS149213 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 JPY 1%	20.12.2025 75.000.000,00 -75.000.000,00	JPY JPY	1,0000	-2.225,16	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS150376 CDS Reference Asset 20.12.22/20.09.27 USD Iron Mountain Inc. DL-Notes 2017(17/27) 144A CDS Gebührenleg 20.12.22/20.09.27 USD 5%	20.09.2027 3.600.000,00 -3.600.000,00	USD USD	5,0000	-435.244,49	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS150437 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 2.980.000,00 -2.980.000,00	EUR EUR	1,0000	-24.583,24	J.P. Morgan SE Frankfurt

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS150438 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 2.980.000,00 -2.980.000,00	EUR EUR	1,0000	-24.583,24	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS150439 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 1.780.000,00 -1.780.000,00	EUR EUR	1,0000	-14.683,95	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS150440 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 4.180.000,00 -4.180.000,00	EUR EUR	1,0000	-34.482,54	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS150441 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 1.780.000,00 -1.780.000,00	EUR EUR	1,0000	-14.683,95	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS150549 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 2.650.000,00 -2.650.000,00	EUR EUR	1,0000	-21.860,94	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS150597 CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 2.700.000,00 -2.700.000,00	EUR EUR	1,0000	-22.273,41	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS150932 CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 360.000,00 -360.000,00	EUR EUR	1,0000	-2.969,79	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS150933 CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 270.000,00 -270.000,00	EUR EUR	1,0000	-2.227,34	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS150934 CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 1.170.000,00 -1.170.000,00	EUR EUR	1,0000	-9.651,81	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS151172 CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 2.700.000,00 -2.700.000,00	EUR EUR	1,0000	-22.273,41	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS152145 CDS Reference Asset 20.03.23/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22) Reg.S CDS Gebührenleg 20.03.23/20.09.25 EUR 5%	20.09.2025 1.100.000,00 -1.100.000,00	EUR EUR	5,0000	7.160,49	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS152146 CDS Reference Asset 20.03.23/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22) Reg.S CDS Gebührenleg 20.03.23/20.09.25 EUR 5%	20.09.2025 570.000,00 -570.000,00	EUR EUR	5,0000	3.710,43	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS152255 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR Societe Generale SRO LAC CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 1%	20.06.2028 3.500.000,00 -3.500.000,00	EUR EUR	1,0000	7.843,71	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS152257 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBLO CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 1.400.000,00 -1.400.000,00	EUR EUR	1,0000	17.444,96	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS152306 CDS Reference Asset 20.03.23/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22) Reg.S CDS Gebührenleg 20.03.23/20.09.25 EUR 5%	20.09.2025 620.000,00 -620.000,00	EUR EUR	5,0000	4.035,91	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS152307 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBLO CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 2.340.000,00 -2.340.000,00	EUR EUR	1,0000	29.158,00	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS152548 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31) CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 USD 5%	20.06.2028 4.000.000,00 -4.000.000,00	USD USD	5,0000	-655.619,22	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS153012 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBLO CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 1%	20.06.2028 2.000.000,00 -2.000.000,00	EUR EUR	1,0000	-7.157,12	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS153102 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 USD Türkei, Republik DL-Bonds 2000(30) CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 USD 1%	20.06.2028 5.000.000,00 -5.000.000,00	USD USD	1,0000	693.028,83	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS153117 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.25 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.25 EUR 1%	20.06.2025 2.500.000,00 -2.500.000,00	EUR EUR	1,0000	-18.743,87	Deutsche Bank AG Frankfurt

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS153118 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 125.000.000,00 -125.000.000,00	JPY JPY	1,0000	15.315,42	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS153119 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.30 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.30 JPY 1%	20.06.2030 500.000.000,00 -500.000.000,00	JPY JPY	1,0000	134.987,67	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS153324 CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.26 USD Carnival Corp. DL-Notes 1998(28) CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.26 USD 1%	20.03.2026 3.850.000,00 -3.850.000,00	USD USD	1,0000	215.362,23	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS153427 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 USD Louisiana Pacific Corp. DL-Notes 2021(21/29) 144A CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 USD 5%	20.06.2028 1.000.000,00 -1.000.000,00	USD USD	5,0000	-149.047,41	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS153428 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 USD Louisiana Pacific Corp. DL-Notes 2021(21/29) 144A CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 USD 5%	20.06.2028 2.000.000,00 -2.000.000,00	USD USD	5,0000	-298.094,82	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfu
SWAPCDS153489 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.33 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2020(25) CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.33 EUR 1%	20.06.2033 2.500.000,00 -2.500.000,00	EUR EUR	1,0000	83.125,32	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS153490 CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.27 EUR Societe Generale SRO LAC CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.27 EUR 1%	20.03.2027 2.125.000,00 -2.125.000,00	EUR EUR	1,0000	-13.492,99	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS153548 CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.33 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2020(25) CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.33 EUR 1%	20.06.2033 2.500.000,00 -2.500.000,00	EUR EUR	1,0000	83.125,32	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS153565 CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.25 EUR Societe Generale SRO LAC CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 3.000.000,00 -3.000.000,00	EUR EUR	1,0000	-26.014,86	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS153656 CDS Reference Asset 20.06.23/20.12.25 EUR Societe Generale SRO LAC CDS Gebührenleg 20.06.23/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 5.000.000,00 -5.000.000,00	EUR EUR	1,0000	-43.358,09	Deutsche Bank AG Frankfurt

XAIA Credit Basis II

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
	Nominale 1					
	Nominale 2					
SWAPCDS153675	20.03.2025					
CDS Reference Asset 20.06.23/20.03.25 EUR UBS Group AG EO-Notes 2016(23/24)	7.000.000,00	EUR			-42.193,98	
CDS Gebührenleg 20.06.23/20.03.25 EUR 1%	-7.000.000,00	EUR		1,0000		J.P. Morgan SE Frankfurt
Credit Default Swaps gesamt					473.420,55	
Swaps gesamt					24.430.232,85	
Derivate gesamt					30.440.475,30	

XAIA Credit Basis II

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

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2020	Stück	604.022,296	EUR	585.729.876,72	EUR	969,72
2021	Stück	513.519,713	EUR	498.578.583,38	EUR	970,90
2022	Stück	373.643,563	EUR	363.294.663,19	EUR	972,30
30.06.2023	Stück	284.840,673	EUR	282.393.805,91	EUR	991,41

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	373.643,563
Ausgegebene Anteile	10.898,559
Zurückgenommene Anteile	-99.701,449
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	284.840,673

XAIA Credit Basis II

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

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2020	Stück	70.409,408	EUR	6.680.407,67	EUR	94,88
2021	Stück	61.231,343	EUR	5.813.728,34	EUR	94,95
2022	Stück	51.656,687	EUR	4.906.127,26	EUR	94,98
30.06.2023	Stück	46.149,130	EUR	4.455.689,45	EUR	96,55

Entwicklung des Anteilumlafs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	51.656,687
Ausgegebene Anteile	0,000
Zurückgenommene Anteile	-5.507,557
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	46.149,130

XAIA Credit Basis II

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

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2020	Stück	255.226,409	EUR	275.836.451,44	EUR	1.080,75
2021	Stück	289.879,409	EUR	317.486.276,74	EUR	1.095,24
2022	Stück	214.011,409	EUR	237.154.958,63	EUR	1.108,14
30.06.2023	Stück	169.952,947	EUR	192.035.828,17	EUR	1.129,94

Entwicklung des Anteilumlafs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	214.011,409
Ausgegebene Anteile	4.554,538
Zurückgenommene Anteile	-48.613,000
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	169.952,947

XAIA Credit Basis II

XAIA Credit Basis II (R) Vergleichende Übersicht seit Auflage

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2020 *)	Stück	15.750,000	EUR	1.582.229,73	EUR	100,46
2021	Stück	16.742,000	EUR	1.684.156,18	EUR	100,59
2022	Stück	16.742,000	EUR	1.685.225,30	EUR	100,66
30.06.2023	Stück	15.242,000	EUR	1.564.022,55	EUR	102,61

*) Auflagedatum: 01.07.2020

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	16.742,000
Ausgegebene Anteile	0,000
Zurückgenommene Anteile	-1.500,000
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	15.242,000

XAIA Credit Debt Capital

Vermögensübersicht zum 30.06.2023

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen *)
I. Vermögensgegenstände	251.526.293,27	104,22
1. Anleihen	151.845.988,64	62,93
2. Derivate	12.326.129,77	5,11
3. Bankguthaben	83.730.143,03	34,68
4. Sonstige Vermögensgegenstände	3.624.031,82	1,50
II. Verbindlichkeiten	-10.213.799,23	-4,22
III. Fondsvermögen	241.312.494,04	100,00

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

XAIA Credit Debt Capital

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2023	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
Bestandspositionen				EUR		151.845.988,64	62,93
Börsengehandelte Wertpapiere				EUR		72.059.190,97	29,86
Verzinsliche Wertpapiere				EUR		72.059.190,97	29,86
0,2500 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 21(26/27)	FR0014002X43	%	5.000	EUR	88,459	4.422.946,83	1,83
5,0000 % SoftBank Group Corp. EO-Notes 2018(18/28)	XS1793255941	%	9.850	EUR	92,827	9.143.441,40	3,79
4,1770 % UBS Group AG EO-FLR Med.-T. Nts 2021(25/26)	CH0591979635	%	26.057	EUR	98,329	25.621.565,60	10,62
7,3850 % Barclays PLC DL-FLR Notes 2022(22/28)	US06738ECD58	%	3.000	USD	104,076	2.862.117,20	1,19
4,0410 % HSBC Holdings PLC DL-FLR Notes 2017(27/28)	US404280BK42	%	5.000	USD	93,573	4.288.784,55	1,78
4,7550 % HSBC Holdings PLC DL-FLR Notes 2022(22/28)	US404280DF39	%	10.000	USD	95,854	8.786.732,19	3,64
7,4500 % Safeway Inc. DL-Debts. 1997(97/27)	US786514AS84	%	750	USD	104,953	721.558,67	0,30
7,8750 % Société Générale S.A. DL-FLR Notes 2013(23/Und.)RegS	USF8586CRW49	%	5.000	USD	97,926	4.488.300,80	1,86
7,7670 % Standard Chartered PLC DL-FLR Notes 2022(27/28) 144A	US853254CN89	%	10.000	USD	106,061	9.722.376,86	4,03
5,1250 % UBS Group AG DL-FLR Bonds 2020(26/Und.)	CH0558521263	%	2.500	USD	87,332	2.001.366,87	0,83
An regulierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				EUR		61.034.490,49	25,29
Verzinsliche Wertpapiere				EUR		61.034.490,49	25,29
3,7500 % Stena International S.A. EO-Notes 2020(20/25) Reg.S	XS2110768525	%	4.000	EUR	96,513	3.860.530,68	1,60
9,0730 % Stonegate Pub Comp.Fin.19 PLC EO-FLR Notes 2020(20/25) Reg.S	XS2210013970	%	2.500	EUR	93,167	2.329.166,48	0,97
9,2500 % Barclays PLC LS-FLR Notes 2023(28/Und.)	XS2591803841	%	2.500	GBP	90,063	2.624.516,39	1,09
8,0000 % Barclays PLC DL-FLR Securit. 2022(29/Und.)	US06738EBX22	%	2.500	USD	88,859	2.036.364,19	0,84
4,1250 % Crocs Inc. DL-Notes 2021(21/31) 144A	US227046AB51	%	5.000	USD	80,039	3.668.473,42	1,52
6,0000 % Deutsche Bank AG DL-FLR-Nachr.Anl.v.20(25/unb.)	US251525AX97	%	3.000	USD	78,846	2.168.274,31	0,90
3,5470 % Deutsche Bank AG FLR-DL-Senior Nts v.20(30/31)	US251526CD98	%	5.000	USD	82,576	3.784.768,46	1,57
8,2480 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-FLR Pref.MTN 22(32/33) 144A	US46115HBV87	%	10.000	USD	104,723	9.599.699,78	3,98
6,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-Notes 2023(33) 144A X	US46115HBZ91	%	2.500	USD	99,111	2.271.314,73	0,94
4,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-Receipts 2019(29) Cl.X 144A	US46115HBL06	%	5.000	USD	86,957	3.985.545,70	1,65
4,8100 % Nissan Motor Co. Ltd. DL-Notes 2020(20/30) Reg.S	USJ57160DZ32	%	8.200	USD	87,253	6.558.592,40	2,72
6,4460 % Société Générale S.A. DL-FLR N-Pf.MTN 23(28/29) 144A	US83368RBR21	%	10.000	USD	100,131	9.178.770,08	3,80
6,1250 % Tenet Healthcare Corp. DL-Notes 2023(23/30)	US88033GDQ01	%	10.000	USD	97,837	8.968.473,87	3,72
Nichtnotierte Wertpapiere				EUR		18.752.307,18	7,77
Verzinsliche Wertpapiere				EUR		18.752.307,18	7,77
1,9000 % WD Invest S.à.r.l. EO-Umtauschanl. 2019(24)	DE000A2R76L7	%	1.400	EUR	13,685	191.596,59	0,08
7,5000 % Alb.Cos LLC/Safe.Inc/N.A.I./A. DL-Notes 2019(19/26) 144A	US013092AA91	%	1.200	USD	101,495	1.116.450,23	0,46

XAIA Credit Debt Capital

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2023	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
8,2480 % Intesa Sanpaolo S.p.A. DL-FLR Pref.MTN 22(32/33)Reg.S	XS2559133363	%	8.500	USD	104,723	8.159.744,82	3,38
1,9820 % UniCredit S.p.A. DL-FLR Pref. MTN 2021(26/27)	US904678AW97	%	5.000	USD	87,873	4.027.536,56	1,67
3,1270 % UniCredit S.p.A. DL-FLR Pref. MTN 2021(31/32)	US904678AY53	%	7.250	USD	79,101	5.256.978,98	2,18
Summe Wertpapiervermögen				EUR		151.845.988,64	62,93
Derivate				EUR		12.326.129,77	5,11
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds				EUR		83.730.143,03	34,68
Bankguthaben				EUR		83.730.143,03	34,68
Guthaben bei Skandinaviska Enskilda Banken AB Stockholm Vorzeitig kündbares Termingeld			5.167,40	CHF		5.295,55	0,00
			69.628,00	JPY		441,64	0,00
Guthaben bei Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen			8.456,66	CHF		8.666,38	0,00
			123,54	GBP		144,00	0,00
			0,99	ZAR		0,05	0,00
Guthaben bei Bayerische Landesbank München Vorzeitig kündbares Termingeld			17.000.000,00	EUR		17.000.000,00	7,04
Guthaben bei HSBC Continental Europe S.A. - Paris Vorzeitig kündbares Termingeld			15.133.815,17	EUR		15.133.815,17	6,27
Guthaben bei Landesbank Baden-Württemberg Stuttgart Vorzeitig kündbares Termingeld			1.000.000,00	EUR		1.000.000,00	0,41
			22.000.000,00	USD		20.166.834,72	8,36
Guthaben bei Sparkasse Saarbrücken Guthaben in Fondswährung			5.000.000,00	EUR		5.000.000,00	2,07
Vorzeitig kündbares Termingeld			16.000.000,00	EUR		16.000.000,00	6,63
Guthaben bei HSBC Bank PLC London Vorzeitig kündbares Termingeld			68.094,63	GBP		79.373,62	0,03
Guthaben bei DBS Group Holdings Ltd., Singapore Vorzeitig kündbares Termingeld			10.184.175,39	USD		9.335.571,90	3,87

XAIA Credit Debt Capital

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2023	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
Sonstige Vermögensgegenstände				EUR		3.624.031,82	1,50
Zinsansprüche			2.062.791,86	EUR		2.062.791,86	0,85
Zinsansprüche Swaps			1.560.299,08	EUR		1.560.299,08	0,65
Sonstige Forderungen			940,88	EUR		940,88	0,00
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme				EUR		-4.129.766,87	-1,71
Kredite bei Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. EUR - Kredite			-410.059,75	EUR		-410.059,75	-0,17
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen			-4.057.828,51	USD		-3.719.707,12	-1,54
Verbindlichkeiten				EUR		-6.084.032,36	-2,51
Verwaltungsvergütung			-103.592,62	EUR		-103.592,62	-0,04
Performance Fee			-838.815,55	EUR		-838.815,55	-0,35
Verwahrstellenvergütung			-6.951,69	EUR		-6.951,69	0,00
Depotgebühren			-24.610,01	EUR		-24.610,01	-0,01
Prüfungs- und Veröffentlichungskosten			-10.000,01	EUR		-10.000,01	0,00
Taxe d'abonnement			-6.759,41	EUR		-6.759,41	0,00
Zinsverbindlichkeiten Swaps			-1.087.303,07	EUR		-1.087.303,07	-0,45
Verbindlichkeiten aus Cash Collateral			-4.000.000,00	EUR		-4.000.000,00	-1,66
Sonstige Verbindlichkeiten			-6.000,00	EUR		-6.000,00	0,00
Fondsvermögen				EUR		241.312.494,04	100,00
XAIA Credit Debt Capital							
Anteilwert				EUR		1.049,06	
Ausgabepreis				EUR		1.049,06	
Rücknahmepreis				EUR		1.049,06	
Anteile im Umlauf				STK		33.408,128	
XAIA Credit Debt Capital (P)							
Anteilwert				EUR		102,04	
Ausgabepreis				EUR		105,10	
Rücknahmepreis				EUR		102,04	
Anteile im Umlauf				STK		39.605,757	

XAIA Credit Debt Capital

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. % in 1.000	Bestand 30.06.2023	Währung	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens *)
XAIA Credit Debt Capital (V)							
Anteilwert				EUR		103,34	
Ausgabepreis				EUR		108,51	
Rücknahmepreis				EUR		103,34	
Anteile im Umlauf				STK		361.920,227	
XAIA Credit Debt Capital (IT)							
Anteilwert				EUR		1.191,00	
Ausgabepreis				EUR		1.191,00	
Rücknahmepreis				EUR		1.191,00	
Anteile im Umlauf				STK		135.580,561	
XAIA Credit Debt Capital (R)							
Anteilwert				EUR		102,75	
Ausgabepreis				EUR		105,83	
Rücknahmepreis				EUR		102,75	
Anteile im Umlauf				STK		32.554,000	

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

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Optionsrechte auf Aktien zum 30.06.2023

Bezeichnung	Verfall	Anzahl	Whg	Einst. Preis in Whg	Tagespreis in Whg	Tageswert in EUR	Unreal. Ergebnis in EUR
AMERICAN AIRL. PUT 17.01.25 BP 3,00 CBOE	17.01.2025	5.100	USD	0,5102	0,1299	60.746,85	-208.976,38
AMERICAN AIRL. PUT 19.01.24 BP 3,00 CBOE	19.01.2024	21.810	USD	0,3380	0,0190	37.991,52	-661.354,92
AMERICAN AIRL. PUT 21.06.24 BP 3,00 CBOE	21.06.2024	4.107	USD	0,4930	0,0721	27.147,47	-170.562,81
BARCLAYS PLC PUT 21.06.24 BP 0,80 ICE	21.06.2024	5.300	GBP	0,0360	0,0201	124.442,07	-92.904,00
CELLNEX TELE PUT 15.12.23 BP 24,00 MEFF	15.12.2023	600	EUR	2,2350	0,1624	9.743,67	-124.356,33
CELLNEX TELE PUT 15.12.23 BP 24,00 OTC	15.12.2023	-60.000	EUR	1,0856	0,1624	-9.743,67	55.392,33
CROCS INC. DL PUT 17.01.25 BP 82,50 CBOE	17.01.2025	415	USD	13,0202	11,5849	440.711,66	-63.805,89
DEUTSCHE BANK AG PUT 21.06.24 BP 4,80 EUREX	21.06.2024	4.600	EUR	0,2291	0,1840	84.625,93	-20.748,07
FORD MOTOR PUT 17.01.25 BP 4,35 CBOE	17.01.2025	3.500	USD		0,10	32.033,21	32.033,21
GOODYEAR TIRE&RUB. PUT 19.01.24 BP 5,00 CBOE	19.01.2024	3.600	USD	0,5202	0,02	6.918,83	-177.240,87
LUFTHANSA AG PUT 15.12.23 BP 4,00 EUREX	15.12.2023	3.250	EUR	0,5871	0,0157	5.111,12	-185.681,89
NORDSTROM INC. PUT 17.01.25 BP 10,00 CBOE	17.01.2025	1.000	USD	1,9002	0,9611	88.102,45	-86.068,04
NORDSTROM INC. PUT 17.01.25 BP 7,50 CBOE	17.01.2025	1.800	USD	1,1617	0,5240	86.456,41	-106.623,92
NRG ENERGY INC. PUT 17.01.25 BP 20,00 CBOE	17.01.2025	1.810	USD	2,2148	0,8368	138.844,27	-239.421,91
RITE AID PUT 17.01.25 BP 2,00 CBOE	17.01.2025	11.250	USD	0,6978	1,1255	1.160.711,29	363.725,21
RUSSELL 2000 INDEX PUT 15.12.23 BP 1400,00 CBOE	15.12.2023	5	USD	73,0252	8,7242	3.998,62	-32.871,62
RUSSELL 2000 INDEX PUT 15.12.23 BP 1600,00 CBOE	15.12.2023	7	USD	117,5252	20,9549	13.446,19	-69.627,26
STE GENERALE INH. PUT 21.06.24 BP 8,80 EUREX	21.06.2024	5.000	EUR	0,5521	0,1333	66.636,67	-209.398,33
TEVA PHARM. IND.ADR PUT 17.01.25 BP 3,00 CBOE	17.01.2025	4.950	USD	0,3324	0,0692	31.405,61	-138.239,31
UBS GROUP PUT 21.06.24 BP 10,00 EUREX	21.06.2024	1.000	CHF	0,5122	0,1532	15.702,52	-35.738,68
UBS GROUP PUT 21.06.24 BP 8,00 EUREX	21.06.2024	1.250	CHF	0,4190	0,0783	10.026,67	-43.003,40
UNITED CONTL. PUT 20.06.25 BP 20,00 CBOE	20.06.2025	1.390	USD	1,8602	1,0117	128.902,21	-105.967,26
US STEELPUT19.01.2024BP7CFLEX	19.01.2024	1.191	USD	0,7402	0,0360	3.935,24	-72.332,45
Optionsrechte auf Aktien gesamt						2.567.896,81	

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Devisentermingeschäfte zum 30.06.2023

	Währung 1	Betrag 1	Währung 2	Betrag 2	Fälligkeit	unreal. Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Verkauf	GBP	-2.520.000,00	Kauf	EUR 2.926.795,28	07.07.2023	-9.750,26	J.P. Morgan SE Frankfurt
Verkauf	JPY	-211.200.000,00	Kauf	EUR 1.421.795,68	07.07.2023	81.220,38	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	JPY	-6.700.000,00	Kauf	EUR 43.302,29	07.07.2023	774,57	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Verkauf	USD	-4.500.000,00	Kauf	EUR 4.192.322,91	07.07.2023	68.619,13	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Verkauf	USD	-136.000.000,00	Kauf	EUR 126.979.977,31	07.07.2023	2.352.485,22	J.P. Morgan SE Frankfurt
Verkauf	USD	-4.500.000,00	Kauf	EUR 4.166.669,75	07.07.2023	42.965,97	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
Devisentermingeschäfte gesamt						2.536.315,01	

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
	Nominale 1 Nominale 2					
Zinsswaps						
SWAPIRS107524	01.11.2024					
Floating Leg 01.11.19/01.11.24 EUR (Floater)	8.000.000,00	EUR		3,2500 variabel	431.788,05	J.P. Morgan SE Frankfurt
Fixed Leg 01.11.19/01.11.24 EUR -0,307% (Zinssatz fest)	-8.000.000,00	EUR		-0,3070 fix		
SWAPIRS110613	28.01.2024					
Floating Leg 28.01.20/28.01.24 USD 5,27271% (Floater)	9.500.000,00	USD		5,2727 variabel	203.794,53	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 28.01.20/28.01.24 USD 1,5545% (Zinssatz fest)	-9.500.000,00	USD		1,5545 fix		
SWAPIRS113032	24.03.2028					
Floating Leg 24.03.20/24.03.28 EUR 3,6% (Floater)	2.000.000,00	EUR		3,6000 variabel	281.627,67	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 24.03.20/24.03.28 EUR -0,045% (Zinssatz fest)	-2.000.000,00	EUR		-0,0450 fix		
SWAPIRS113037	24.03.2024					
Floating Leg 24.03.20/24.03.24 USD 5,54186% (Floater)	4.200.000,00	USD		5,5419 variabel	139.422,33	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 24.03.20/24.03.24 USD 0,61% (Zinssatz fest)	-4.200.000,00	USD		0,6100 fix		
SWAPIRS113648	07.04.2027					
Floating Leg 07.04.20/07.04.27 USD 5,211% (Floater)	2.000.000,00	USD		5,2110 variabel	243.039,79	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 07.04.20/07.04.27 USD 0,555% (Zinssatz fest)	-2.000.000,00	USD		0,5550 fix		
SWAPIRS114494	12.05.2025					
Floating Leg 12.05.20/12.05.25 USD 5,34243% (Floater)	2.000.000,00	USD		5,3424 variabel	152.939,83	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 12.05.20/12.05.25 USD 0,4035% (Zinssatz fest)	-2.000.000,00	USD		0,4035 fix		
SWAPIRS115267	01.06.2028					
Floating Leg 01.06.20/01.06.28 USD 5,496% (Floater)	6.000.000,00	USD		5,4960 variabel	871.328,11	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 01.06.20/01.06.28 USD 0,587% (Zinssatz fest)	-6.000.000,00	USD		0,5870 fix		
SWAPIRS116368	09.07.2029					
Floating Leg 09.07.20/09.07.29 USD 5,211% (Floater)	1.350.000,00	USD		5,2110 variabel	223.098,42	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 09.07.20/09.07.29 USD 0,589% (Zinssatz fest)	-1.350.000,00	USD		0,5890 fix		
SWAPIRS118371	28.08.2023					
Floating Leg 28.08.20/28.08.23 EUR 3,457% (Floater)	4.500.000,00	EUR		3,4570 variabel	28.203,33	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 28.08.20/28.08.23 EUR -0,463% (Zinssatz fest)	-4.500.000,00	EUR		-0,4630 fix		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
	Nominale 1 Nominale 2					
SWAPIRS118380	28.08.2027					
Floating Leg 28.08.20/28.08.27 EUR 3,457% (Floater)	1.300.000,00	EUR		3,4570 variabel	180.574,32	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 28.08.20/28.08.27 EUR -0,337% (Zinssatz fest)	-1.300.000,00	EUR		-0,3370 fix		
SWAPIRS119827	19.10.2027					
Floating Leg 19.10.20/19.10.27 USD 5,265% (Floater)	7.000.000,00	USD		5,2650 variabel	940.122,03	Deutsche Bank AG London
Fixed Leg 19.10.20/19.10.27 USD 0,524% (Zinssatz fest)	-7.000.000,00	USD		0,5240 fix		
SWAPIRS122550	24.02.2027					
Floating Leg 24.02.21/24.02.27 EUR 3,412% (Floater)	1.900.000,00	EUR		3,4120 variabel	236.781,82	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 24.02.21/24.02.27 EUR -0,302% (Zinssatz fest)	-1.900.000,00	EUR		-0,3020 fix		
SWAPIRS122603	24.02.2031					
Floating Leg 24.02.21/24.02.31 USD 5,37471% (Floater)	900.000,00	USD		5,3747 variabel	132.336,65	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 24.02.21/24.02.31 USD 1,452% (Zinssatz fest)	-900.000,00	USD		1,4520 fix		
SWAPIRS127142	10.06.2027					
Floating Leg 10.06.21/10.06.27 EUR 3,486% (Floater)	6.000.000,00	EUR		3,4860 variabel	779.670,76	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 10.06.21/10.06.27 EUR -0,248% (Zinssatz fest)	-6.000.000,00	EUR		-0,2480 fix		
SWAPIRS127143	10.06.2025					
Floating Leg 10.06.21/10.06.25 USD 5,53971% (Floater)	1.700.000,00	USD		5,5397 variabel	127.934,37	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 10.06.21/10.06.25 USD 0,635% (Zinssatz fest)	-1.700.000,00	USD		0,6350 fix		
SWAPIRS128426	24.08.2025					
Floating Leg 24.08.21/24.08.25 USD 5,37471% (Floater)	5.000.000,00	USD		5,3747 variabel	397.718,72	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 24.08.21/24.08.25 USD 0,715% (Zinssatz fest)	-5.000.000,00	USD		0,7150 fix		
SWAPIRS133521	10.02.2026					
Floating Leg 10.02.22/10.02.26 EUR 3,312% (Floater)	1.000.000,00	EUR		3,3120 variabel	77.503,77	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 10.02.22/10.02.26 EUR 0,458% (Zinssatz fest)	-1.000.000,00	EUR		0,4580 fix		
SWAPIRS140362	29.06.2031					
Floating Leg 29.06.22/29.06.31 EUR 3,554% (Floater)	700.000,00	EUR		3,5540 variabel	38.326,19	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 29.06.22/29.06.31 EUR 2,2265% (Zinssatz fest)	-700.000,00	EUR		2,2265 fix		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
	Nominale 1 Nominale 2					
SWAPIRS146709	16.11.2027					
Floating Leg 16.11.22/16.11.27 EUR 3,348% (Floater)	2.300.000,00	EUR		3,3480 variabel	52.901,23	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 16.11.22/16.11.27 EUR 2,704% (Zinssatz fest)	-2.300.000,00	EUR		2,7040 fix		
SWAPIRS146917	21.11.2032					
Floating Leg 21.11.22/21.11.32 USD 4,60103% (Floater)	4.000.000,00	USD		4,6010 variabel	32.016,15	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 21.11.22/21.11.32 USD 3,427% (Zinssatz fest)	-4.000.000,00	USD		3,4270 fix		
SWAPIRS147118	23.11.2028					
Floating Leg 23.11.22/23.11.28 USD 4,60824% (Floater)	2.250.000,00	USD		4,6082 variabel	11.503,57	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 23.11.22/23.11.28 USD 3,703% (Zinssatz fest)	-2.250.000,00	USD		3,7030 fix		
SWAPIRS147260	30.11.2028					
Floating Leg 30.11.22/30.11.28 USD 4,6346% (Floater)	1.500.000,00	USD		4,6346 variabel	17.791,82	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 30.11.22/30.11.28 USD 3,55% (Zinssatz fest)	-1.500.000,00	USD		3,5500 fix		
SWAPIRS147262	30.11.2032					
Floating Leg 30.11.22/30.11.32 USD 4,6346% (Floater)	1.350.000,00	USD		4,6346 variabel	15.520,38	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 30.11.22/30.11.32 USD 3,379% (Zinssatz fest)	-1.350.000,00	USD		3,3790 fix		
SWAPIRS147266	29.11.2028					
Floating Leg 29.11.22/29.11.28 USD 4,63079% (Floater)	3.400.000,00	USD		4,6308 variabel	32.840,44	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 29.11.22/29.11.28 USD 3,6001% (Zinssatz fest)	-3.400.000,00	USD		3,6001 fix		
SWAPIRS147267	29.11.2031					
Floating Leg 29.11.22/29.11.31 USD 4,63079% (Floater)	2.000.000,00	USD		4,6308 variabel	20.128,14	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 29.11.22/29.11.31 USD 3,426% (Zinssatz fest)	-2.000.000,00	USD		3,4260 fix		
SWAPIRS147317	05.12.2028					
Floating Leg 05.12.22/05.12.28 USD 4,65414% (Floater)	3.000.000,00	USD		4,6541 variabel	53.917,27	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 05.12.22/05.12.28 USD 3,411% (Zinssatz fest)	-3.000.000,00	USD		3,4110 fix		
SWAPIRS147374	06.12.2028					
Floating Leg 06.12.22/06.12.28 USD 4,65414% (Floater)	2.550.000,00	USD		4,6541 variabel	54.510,43	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 06.12.22/06.12.28 USD 3,334% (Zinssatz fest)	-2.550.000,00	USD		3,3340 fix		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
	Nominale 1 Nominale 2					
SWAPIRS148148	19.12.2028					
Floating Leg 19.12.22/19.12.28 EUR 3,547% (Floater)	1.200.000,00	EUR		3,5470 variabel	33.852,68	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 19.12.22/19.12.28 EUR 2,581% (Zinssatz fest)	-1.200.000,00	EUR		2,5810 fix		
SWAPIRS148563	13.01.2033					
Floating Leg 13.01.23/13.01.33 USD 4,76316% (Floater)	2.000.000,00	USD		4,7632 variabel	43.281,77	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 13.01.23/13.01.33 USD 3,238% (Zinssatz fest)	-2.000.000,00	USD		3,2380 fix		
SWAPIRS148608	17.01.2029					
Floating Leg 17.01.23/17.01.29 USD 4,77425% (Floater)	1.500.000,00	USD		4,7743 variabel	32.438,28	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 17.01.23/17.01.29 USD 3,324% (Zinssatz fest)	-1.500.000,00	USD		3,3240 fix		
SWAPIRS148644	19.01.2032					
Floating Leg 19.01.23/19.01.32 USD 4,77994% (Floater)	800.000,00	USD		4,7799 variabel	18.087,23	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 19.01.23/19.01.32 USD 3,2315% (Zinssatz fest)	-800.000,00	USD		3,2315 fix		
SWAPIRS148841	01.02.2029					
Floating Leg 01.02.23/01.02.29 USD 4,82079% (Floater)	3.700.000,00	USD		4,8208 variabel	71.056,71	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 01.02.23/01.02.29 USD 3,3755% (Zinssatz fest)	-3.700.000,00	USD		3,3755 fix		
SWAPIRS148860	02.02.2028					
Floating Leg 02.02.23/02.02.28 USD 4,82417% (Floater)	5.700.000,00	USD		4,8242 variabel	113.597,42	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 02.02.23/02.02.28 USD 3,419% (Zinssatz fest)	-5.700.000,00	USD		3,4190 fix		
SWAPIRS149069	07.02.2031					
Floating Leg 07.02.23/07.02.31 USD 4,83349% (Floater)	4.000.000,00	USD		4,8335 variabel	85.728,07	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 07.02.23/07.02.31 USD 3,265% (Zinssatz fest)	-4.000.000,00	USD		3,2650 fix		
SWAPIRS149170	09.02.2029					
Floating Leg 09.02.23/09.02.29 USD 4,83743% (Floater)	3.200.000,00	USD		4,8374 variabel	43.254,92	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 09.02.23/09.02.29 USD 3,499% (Zinssatz fest)	-3.200.000,00	USD		3,4990 fix		
SWAPIRS149249	13.02.2030					
Floating Leg 13.02.23/13.02.30 USD 4,84564% (Floater)	2.800.000,00	USD		4,8456 variabel	42.583,01	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 13.02.23/13.02.30 USD 3,407% (Zinssatz fest)	-2.800.000,00	USD		3,4070 fix		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
	Nominale 1 Nominale 2					
SWAPIRS149365	15.02.2029					
Floating Leg 15.02.23/15.02.29 USD 4,84993% (Floater)	1.900.000,00	USD		4,8499 variabel	14.540,95	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 15.02.23/15.02.29 USD 3,626% (Zinssatz fest)	-1.900.000,00	USD		3,6260 fix		
SWAPIRS149366	15.02.2033					
Floating Leg 15.02.23/15.02.33 USD 4,84993% (Floater)	1.600.000,00	USD		4,8499 variabel	10.138,77	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 15.02.23/15.02.33 USD 3,445% (Zinssatz fest)	-1.600.000,00	USD		3,4450 fix		
SWAPIRS149370	16.02.2032					
Floating Leg 16.02.23/16.02.32 USD 4,85212% (Floater)	2.000.000,00	USD		4,8521 variabel	16.874,92	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 16.02.23/16.02.32 USD 3,442% (Zinssatz fest)	-2.000.000,00	USD		3,4420 fix		
SWAPIRS151440	29.03.2028					
Floating Leg 29.03.23/29.03.28 GBP 4,37308% (Floater)	1.600.000,00	GBP		4,3731 variabel	109.015,24	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 29.03.23/29.03.28 GBP 3,792% (Zinssatz fest)	-1.600.000,00	GBP		3,7920 fix		
SWAPIRS152538	24.04.2033					
Floating Leg 24.04.23/24.04.33 USD 5,02% (Floater)	1.300.000,00	USD		5,0200 variabel	26.424,63	Deutsche Bank AG London
Fixed Leg 24.04.23/24.04.33 USD 3,2515% (Zinssatz fest)	-1.300.000,00	USD		3,2515 fix		
SWAPIRS152546	26.04.2033					
Floating Leg 26.04.23/26.04.33 USD 5,02647% (Floater)	2.200.000,00	USD		5,0265 variabel	43.840,23	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 26.04.23/26.04.33 USD 3,2575% (Zinssatz fest)	-2.200.000,00	USD		3,2575 fix		
SWAPIRS153009	18.05.2026					
Floating Leg 18.05.23/18.05.26 USD 5,05543% (Floater)	4.500.000,00	USD		5,0554 variabel	88.377,97	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 18.05.23/18.05.26 USD 3,57875% (Zinssatz fest)	-4.500.000,00	USD		3,5788 fix		
SWAPIRS153104	24.05.2033					
Floating Leg 24.05.23/24.05.33 USD 5,05625% (Floater)	500.000,00	USD		5,0563 variabel	3.792,08	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 24.05.23/24.05.33 USD 3,419% (Zinssatz fest)	-500.000,00	USD		3,4190 fix		
SWAPIRS153152	26.05.2029					
Floating Leg 26.05.23/26.05.29 USD 5,05632% (Floater)	4.000.000,00	USD		5,0563 variabel	54.913,90	Deutsche Bank AG Frankfurt
Fixed Leg 26.05.23/26.05.29 USD 3,466% (Zinssatz fest)	-4.000.000,00	USD		3,4660 fix		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPIRS153276	05.06.2033				
Floating Leg 05.06.23/05.06.33 USD (Floater)	2.000.000,00	USD	0,0000 variabel	11.933,33	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 05.06.23/05.06.33 USD 3,439% (Zinssatz fest)	-2.000.000,00	USD	3,4390 fix		
SWAPIRS153277	05.06.2028				
Floating Leg 05.06.23/05.06.28 USD (Floater)	1.800.000,00	USD	0,0000 variabel	19.693,14	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 05.06.23/05.06.28 USD 3,608% (Zinssatz fest)	-1.800.000,00	USD	3,6080 fix		
SWAPIRS153325	06.06.2030				
Floating Leg 06.06.23/06.06.30 USD (Floater)	2.400.000,00	USD	0,0000 variabel	34.705,65	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 06.06.23/06.06.30 USD 3,402% (Zinssatz fest)	-2.400.000,00	USD	3,4020 fix		
SWAPIRS153335	07.06.2031				
Floating Leg 07.06.23/07.06.31 USD (Floater)	3.300.000,00	USD	0,0000 variabel	26.302,95	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
Fixed Leg 07.06.23/07.06.31 USD 3,46875% (Zinssatz fest)	-3.300.000,00	USD	3,4688 fix		
SWAPIRS153374	13.06.2025				
Floating Leg 13.06.23/13.06.25 USD (Floater)	2.500.000,00	USD	0,0000 variabel	13.897,70	Deutsche Bank AG London
Fixed Leg 13.06.23/13.06.25 USD 4,451% (Zinssatz fest)	-2.500.000,00	USD	4,4510 fix		
SWAPIRS153375	13.06.2028				
Floating Leg 13.06.23/13.06.28 USD (Floater)	1.600.000,00	USD	0,0000 variabel	13.702,02	Deutsche Bank AG London
Fixed Leg 13.06.23/13.06.28 USD 3,663% (Zinssatz fest)	-1.600.000,00	USD	3,6630 fix		
SWAPIRS153376	13.06.2030				
Floating Leg 13.06.23/13.06.30 USD (Floater)	2.000.000,00	USD	0,0000 variabel	13.427,86	Deutsche Bank AG London
Fixed Leg 13.06.23/13.06.30 USD 3,5405% (Zinssatz fest)	-2.000.000,00	USD	3,5405 fix		
SWAPIRS153543	22.06.2033				
Floating Leg 22.06.23/22.06.33 USD (Floater)	2.450.000,00	USD	0,0000 variabel	10.838,70	BNP Paribas S.A. Paris
Fixed Leg 22.06.23/22.06.33 USD 3,4583% (Zinssatz fest)	-2.450.000,00	USD	3,4583 fix		
Zinsswaps gesamt				6.773.640,25	

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
Credit Default Swaps					
SWAPCDS106590 CDS Reference Asset 20.09.19/20.03.24 EUR Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.19/20.03.24 EUR 5%	20.03.2024 4.000.000,00 -4.000.000,00	EUR EUR	5,0000	-113.564,96	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS106591 CDS Reference Asset 20.09.19/20.03.24 EUR Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.19/20.03.24 EUR 5%	20.03.2024 200.000,00 -200.000,00	EUR EUR	5,0000	-5.678,25	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS106808 CDS Reference Asset 20.09.19/20.03.24 EUR Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.19/20.03.24 EUR 5%	20.03.2024 1.000.000,00 -1.000.000,00	EUR EUR	5,0000	-28.391,24	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS106818 CDS Reference Asset 20.09.19/20.03.24 EUR Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.19/20.03.24 EUR 5%	20.03.2024 1.000.000,00 -1.000.000,00	EUR EUR	5,0000	-28.391,24	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS113810 CDS Reference Asset 20.03.20/20.03.24 EUR Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S CDS Gebührenleg 20.03.20/20.03.24 EUR 5%	20.03.2024 2.600.000,00 -2.600.000,00	EUR EUR	5,0000	-73.817,22	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS114439 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 1.250.000,00 -1.250.000,00	USD USD	5,0000	-102.171,02	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS115780 CDS Reference Asset 20.03.20/20.06.25 USD Safeway Inc. DL-Debts 2001(31) CDS Gebührenleg 20.03.20/20.06.25 USD 5%	20.06.2025 1.000.000,00 -1.000.000,00	USD USD	5,0000	-81.736,82	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS124602 CDS Reference Asset 22.03.21/20.06.26 EUR BNP PARIBAS SRO SUB CDS Gebührenleg 22.03.21/20.06.26 EUR 1%	20.06.2026 5.000.000,00 -5.000.000,00	EUR EUR	1,0000	-19.306,92	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
SWAPCDS128448 CDS Reference Asset 22.03.21/20.06.26 EUR Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S CDS Gebührenleg 22.03.21/20.06.26 EUR 5%	20.06.2026 1.000.000,00 -1.000.000,00	EUR EUR	5,0000	-39.987,75	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS129460 CDS Reference Asset 20.09.21/20.12.26 EUR Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.21/20.12.26 EUR 5%	20.12.2026 1.000.000,00 -1.000.000,00	EUR EUR	5,0000	-33.498,82	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid
SWAPCDS133215 CDS Reference Asset 20.12.21/20.12.26 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) CDS Gebührenleg 20.12.21/20.12.26 JPY 1%	20.12.2026 42.000.000,00 -42.000.000,00	JPY JPY	1,0000	9.042,23	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS133216 CDS Reference Asset 20.12.21/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) CDS Gebührenleg 20.12.21/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 310.000.000,00 -310.000.000,00	JPY JPY	1,0000	138.623,73	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS133255 CDS Reference Asset 20.12.21/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) CDS Gebührenleg 20.12.21/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 305.000.000,00 -305.000.000,00	JPY JPY	1,0000	136.387,87	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS133310 CDS Reference Asset 20.12.21/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) CDS Gebührenleg 20.12.21/20.06.28 JPY 1%	20.06.2028 310.000.000,00 -310.000.000,00	JPY JPY	1,0000	138.623,73	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS133333 CDS Reference Asset 20.12.21/20.12.24 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) CDS Gebührenleg 20.12.21/20.12.24 JPY 1%	20.12.2024 145.000.000,00 -145.000.000,00	JPY JPY	1,0000	5.782,30	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS133334 CDS Reference Asset 20.12.21/20.12.26 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) CDS Gebührenleg 20.12.21/20.12.26 JPY 1%	20.12.2026 84.000.000,00 -84.000.000,00	JPY JPY	1,0000	18.084,46	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS133425 CDS Reference Asset 20.12.21/20.12.24 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) CDS Gebührenleg 20.12.21/20.12.24 JPY 1%	20.12.2024 50.000.000,00 -50.000.000,00	JPY JPY	1,0000	1.993,90	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS133426 CDS Reference Asset 20.12.21/20.12.26 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24) CDS Gebührenleg 20.12.21/20.12.26 JPY 1%	20.12.2026 42.000.000,00 -42.000.000,00	JPY JPY	1,0000	9.042,23	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit	Whg 1	Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
	Nominale 1 Nominale 2					
SWAPCDS133427	20.06.2028					
CDS Reference Asset 20.12.21/20.06.28 JPY SoftBank Group Corp. YN-Bonds 2018(24)	310.000.000,00	JPY			138.623,73	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Gebührenleg 20.12.21/20.06.28 JPY 1%	-310.000.000,00	JPY		1,0000		
SWAPCDS137187	20.12.2023					
CDS Gebührenleg 21.03.22/20.12.23 USD 5%	1.250.000,00	USD		5,0000	17.166,73	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 21.03.22/20.12.23 USD American Airlines Group Inc. DL-Notes 2020(20/25) 144A	-1.250.000,00	USD				
SWAPCDS137358	20.12.2023					
CDS Gebührenleg 21.03.22/20.12.23 USD 5%	1.250.000,00	USD		5,0000	17.166,73	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 21.03.22/20.12.23 USD American Airlines Group Inc. DL-Notes 2020(20/25) 144A	-1.250.000,00	USD				
SWAPCDS138411	20.12.2023					
CDS Gebührenleg 21.03.22/20.12.23 USD 5%	1.250.000,00	USD		5,0000	17.166,73	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 21.03.22/20.12.23 USD American Airlines Group Inc. DL-Notes 2020(20/25) 144A	-1.250.000,00	USD				
SWAPCDS138440	20.12.2023					
CDS Gebührenleg 21.03.22/20.12.23 USD 5%	1.300.000,00	USD		5,0000	17.853,40	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 21.03.22/20.12.23 USD American Airlines Group Inc. DL-Notes 2020(20/25) 144A	-1.300.000,00	USD				
SWAPCDS139184	20.12.2023					
CDS Gebührenleg 21.03.22/20.12.23 USD 5%	1.250.000,00	USD		5,0000	17.166,73	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 21.03.22/20.12.23 USD American Airlines Group Inc. DL-Notes 2020(20/25) 144A	-1.250.000,00	USD				
SWAPCDS140701	20.06.2024					
CDS Gebührenleg 21.06.22/20.06.24 USD 5%	1.250.000,00	USD		5,0000	-2.885,52	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid
CDS Reference Asset 21.06.22/20.06.24 USD American Airlines Group Inc. DL-Notes 2020(20/25) 144A	-1.250.000,00	USD				
SWAPCDS144409	20.12.2024					
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.24 USD 5%	1.500.000,00	USD		5,0000	-11.469,98	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.24 USD American Airlines Group Inc. DL-Notes 2020(20/25) 144A	-1.500.000,00	USD				
SWAPCDS145131	20.12.2024					
CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.24 USD 5%	1.000.000,00	USD		5,0000	-559.185,03	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.24 USD Rite Aid Corp. DL-Debts 1996(27)	-1.000.000,00	USD				

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS145516 CDS Reference Asset 20.09.22/20.03.24 EUR Stena AB DL-Notes 2014(14/24) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.03.24 EUR 5%	20.03.2024 1.600.000,00 -1.600.000,00	EUR EUR	5,0000	-45.425,98	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid
SWAPCDS145556 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.24 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.24 EUR 1%	20.06.2024 5.000.000,00 -5.000.000,00	EUR EUR	1,0000	-22.487,74	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS145758 CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 USD 5% CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 USD Ford Motor Co. DL-Notes 2016(26/26)	20.12.2027 1.500.000,00 -1.500.000,00	USD USD	5,0000	123.433,63	Credit Suisse Bank (Europe), S.A. - Madrid
SWAPCDS146225 CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.24 USD 5% CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.24 USD Rite Aid Corp. DL-Debts 1996(27)	20.12.2024 1.000.000,00 -1.000.000,00	USD USD	5,0000	-559.185,03	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS146267 CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.24 USD 5% CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.24 USD Rite Aid Corp. DL-Debts 1996(27)	20.12.2024 250.000,00 -250.000,00	USD USD	5,0000	-139.796,26	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS146747 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 300.000,00 -300.000,00	EUR EUR	1,0000	27,38	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146748 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 300.000,00 -300.000,00	EUR EUR	1,0000	4.309,72	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146749 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 300.000,00 -300.000,00	EUR EUR	1,0000	10.013,74	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146750 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	20.12.2032 1.700.000,00 -1.700.000,00	EUR EUR	1,0000	102.646,32	Deutsche Bank AG Frankfurt

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS146906 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 450.000,00 -450.000,00	EUR EUR	1,0000	41,08	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146907 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 450.000,00 -450.000,00	EUR EUR	1,0000	6.464,57	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146908 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 450.000,00 -450.000,00	EUR EUR	1,0000	15.020,61	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146909 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.32 EUR 1%	20.12.2032 2.550.000,00 -2.550.000,00	EUR EUR	1,0000	153.969,48	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146910 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 250.000,00 -250.000,00	EUR EUR	1,0000	-3.157,56	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146911 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 250.000,00 -250.000,00	EUR EUR	1,0000	-2.594,03	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS146912 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.28 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.28 EUR 1%	20.12.2028 1.800.000,00 -1.800.000,00	EUR EUR	1,0000	-10.461,17	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS147109 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 730.000,00 -730.000,00	EUR EUR	1,0000	9.096,30	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS147110 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 730.000,00 -730.000,00	EUR EUR	1,0000	9.096,30	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS147221 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2016(26) Reg.S CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 3.450.000,00 -3.450.000,00	EUR EUR	1,0000	-35.797,59	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS147223 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 912.500,00 -912.500,00	EUR EUR	1,0000	11.370,37	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS147224 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 730.000,00 -730.000,00	EUR EUR	1,0000	9.096,30	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS147225 CDS Reference Asset 20.09.22/20.06.32 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.06.32 EUR 1%	20.06.2032 730.000,00 -730.000,00	EUR EUR	1,0000	9.096,30	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS147255 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR DEUTSCHE BANK AKTIENGESELLSCHAFT Ref ID: XSLACRE CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 5.000.000,00 -5.000.000,00	EUR EUR	1,0000	108.031,97	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS147293 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 2.720.000,00 -2.720.000,00	EUR EUR	1,0000	-35.128,49	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS147361 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.25 EUR Barclays PLC EO-FLR Med.-Term Nts 18(18/26) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 430.000,00 -430.000,00	EUR EUR	1,0000	-1.551,16	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS147362 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Barclays PLC EO-FLR Med.-Term Nts 18(18/26) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 1.810.000,00 -1.810.000,00	EUR EUR	1,0000	8.582,88	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS147363 CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 EUR Barclays PLC EO-FLR Med.-Term Nts 18(18/26) CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 900.000,00 -900.000,00	EUR EUR	1,0000	4.267,73	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS147729 CDS Gebührenleg 20.09.22/20.12.27 USD 5% CDS Reference Asset 20.09.22/20.12.27 USD NRG Energy Inc. DL-Notes 2017(17/28)	20.12.2027 2.500.000,00 -2.500.000,00	USD USD	5,0000	137.834,45	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS148165 CDS Gebührenleg 21.09.22/20.12.27 USD 5% CDS Reference Asset 21.09.22/20.12.27 USD NRG Energy Inc. DL-Notes 2017(17/28)	20.12.2027 2.500.000,00 -2.500.000,00	USD USD	5,0000	137.834,45	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS148444 CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.28 EUR Societe Generale SRO LAC CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.28 EUR 1%	20.06.2028 3.000.000,00 -3.000.000,00	EUR EUR	1,0000	6.723,18	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS148519 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 EUR 1%	20.12.2025 375.000,00 -375.000,00	EUR EUR	1,0000	34,23	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148520 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 375.000,00 -375.000,00	EUR EUR	1,0000	5.387,15	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148521 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 EUR 1%	20.12.2029 375.000,00 -375.000,00	EUR EUR	1,0000	12.517,17	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148522 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.32 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(23) CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.32 EUR 1%	20.12.2032 2.125.000,00 -2.125.000,00	EUR EUR	1,0000	128.307,90	Deutsche Bank AG Frankfurt
SWAPCDS148602 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 1.800.000,00 -1.800.000,00	EUR EUR	1,0000	-23.246,79	Bank of America Securities Europe SA - Paris
SWAPCDS148707 CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.28 EUR Societe Generale SRO LAC CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.28 EUR 1%	20.06.2028 2.000.000,00 -2.000.000,00	EUR EUR	1,0000	4.482,12	J.P. Morgan SE Frankfurt

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS148854 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 EUR Standard Chartered PLC DL-Notes 2013(24) Reg.S CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 EUR 1%	20.12.2027 5.500.000,00 -5.500.000,00	EUR EUR	1,0000	75.701,40	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS149065 CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.27 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SUB CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.27 EUR 1%	20.06.2027 4.500.000,00 -4.500.000,00	EUR EUR	1,0000	6.530,02	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS149154 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 JPY 1%	20.12.2029 245.000.000,00 -245.000.000,00	JPY JPY	1,0000	57.432,81	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS149164 CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.25 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.25 EUR 1%	20.06.2025 5.000.000,00 -5.000.000,00	EUR EUR	1,0000	-37.487,74	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
SWAPCDS149214 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.25 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.25 JPY 1%	20.12.2025 108.000.000,00 -108.000.000,00	JPY JPY	1,0000	-3.204,23	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS149215 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.27 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.27 JPY 1%	20.12.2027 75.000.000,00 -75.000.000,00	JPY JPY	1,0000	6.941,63	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS149216 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 JPY 1%	20.12.2029 385.000.000,00 -385.000.000,00	JPY JPY	1,0000	90.251,56	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS149250 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.29 JPY Nissan Motor Co. Ltd. YN-Bonds 2020(25) No. 65 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.29 JPY 1%	20.12.2029 203.000.000,00 -203.000.000,00	JPY JPY	1,0000	47.587,18	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS149363 CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.28 EUR INTESA SANPAOLO SPA 20.06.2022 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.28 EUR 1%	20.06.2028 625.000,00 -625.000,00	EUR EUR	1,0000	35.551,27	J.P. Morgan SE Frankfurt

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS149364 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.32 EUR INTESA SANPAOLO SPA 20.06.2022 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.32 EUR 1%	20.12.2032 2.500.000,00 -2.500.000,00	EUR EUR	1,0000	319.512,21	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS149368 CDS Reference Asset 20.12.22/20.06.28 EUR INTESA SANPAOLO SPA 20.06.2022 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.06.28 EUR 1%	20.06.2028 625.000,00 -625.000,00	EUR EUR	1,0000	35.551,27	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
SWAPCDS149369 CDS Reference Asset 20.12.22/20.12.32 EUR INTESA SANPAOLO SPA 20.06.2022 CDS Gebührenleg 20.12.22/20.12.32 EUR 1%	20.12.2032 2.500.000,00 -2.500.000,00	EUR EUR	1,0000	319.512,21	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
SWAPCDS150598 CDS Reference Asset 20.12.22/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.12.22/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 6.300.000,00 -6.300.000,00	EUR EUR	1,0000	-51.971,29	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
SWAPCDS150929 CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 1.800.000,00 -1.800.000,00	EUR EUR	1,0000	-14.848,94	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS150930 CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 1.170.000,00 -1.170.000,00	EUR EUR	1,0000	-9.651,81	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS150931 CDS Reference Asset 20.03.23/20.03.26 EUR Credit Suisse Group AG SRO SENIOR CDS Gebührenleg 20.03.23/20.03.26 EUR 1%	20.03.2026 6.030.000,00 -6.030.000,00	EUR EUR	1,0000	-49.743,95	J.P. Morgan SE Frankfurt
SWAPCDS151439 CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 USD 1% CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 USD Nordstrom Inc. DL-Debts 1998(28)	20.06.2028 3.000.000,00 -3.000.000,00	USD USD	1,0000	-405.638,35	BNP Paribas S.A. Paris
SWAPCDS151895 CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 USD 1% CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 USD Nordstrom Inc. DL-Debts 1998(28)	20.06.2028 2.000.000,00 -2.000.000,00	USD USD	1,0000	-270.425,56	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit	Nominale 1	Nominale 2	Whg 1	Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS152319	20.09.2025							
CDS Reference Asset 20.03.23/20.09.25 EUR Stonegate Pub Company Fin. PLC LS-Notes 2017(17/22) Reg.S	2.375.000,00			EUR			15.460,14	Deutsche Bank AG Frankfurt
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.09.25 EUR 5%	-2.375.000,00			EUR		5,0000		
SWAPCDS152459	20.06.2028							
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR SOCIETE GENERALE SRO SUB	5.000.000,00			EUR			159.597,95	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 1%	-5.000.000,00			EUR		1,0000		
SWAPCDS152535	20.06.2028							
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR INTESA SANPAOLO SPA 20.06.2022	7.500.000,00			EUR			426.615,20	J.P. Morgan SE Frankfurt
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 1%	-7.500.000,00			EUR		1,0000		
SWAPCDS152549	20.06.2028							
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR HSBC HOLDINGS plc SRO SUB	4.600.000,00			EUR			41.363,82	BNP Paribas S.A. Paris
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 1%	-4.600.000,00			EUR		1,0000		
SWAPCDS152713	20.06.2026							
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.26 USD 5%	2.500.000,00			USD		5,0000	106.347,51	Citigroup Global Markets Europe AG - Frankfurt
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.26 USD United Airlines Holdings Inc. DL-Notes 2017(17/24)	-2.500.000,00			USD				
SWAPCDS153010	20.06.2026							
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.26 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI, Ref ID XSSNRREFOBLO	4.500.000,00			EUR			-37.737,89	Bank of America Securities Europe SA - Paris
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.26 EUR 1%	-4.500.000,00			EUR		1,0000		
SWAPCDS153107	20.06.2028							
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI SRO SUB	2.000.000,00			EUR			96.640,30	Morgan Stanley Europe SE - Frankfurt
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 1%	-2.000.000,00			EUR		1,0000		
SWAPCDS153161	20.06.2028							
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 EUR INTESA SANPAOLO SPA 20.06.2022	4.250.000,00			EUR			241.748,61	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 EUR 1%	-4.250.000,00			EUR		1,0000		
SWAPCDS153279	20.06.2028							
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 USD Tenet Healthcare Corp. DL-Notes 2001(01/31)	2.250.000,00			USD			-193.145,61	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 USD 5%	-2.250.000,00			USD		5,0000		

XAIA Credit Debt Capital

Derivate zum 30.06.2023

Swaps zum 30.06.2023

Bezeichnung	Fälligkeit Nominale 1 Nominale 2	Whg 1 Whg 2	Kupon in %	Unrealisiertes Ergebnis in EUR	Gegenpartei
SWAPCDS153371	20.06.2028				
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.28 USD Tenet Healthcare Corp. DL-Notes 2001(01/31)	4.250.000,00	USD		-364.830,60	Goldman Sachs Bank Europe SE - Frankfurt
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.28 USD 5%	-4.250.000,00	USD	5,0000		
SWAPCDS153547	20.06.2033				
CDS Reference Asset 20.03.23/20.06.33 EUR Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2020(25)	2.500.000,00	EUR		83.125,32	Barclays Bank Ireland PLC - Dublin
CDS Gebührenleg 20.03.23/20.06.33 EUR 1%	-2.500.000,00	EUR	1,0000		
Credit Default Swaps gesamt				448.277,70	
Swaps gesamt				7.221.917,95	
Derivate gesamt				12.326.129,77	

XAIA Credit Debt Capital

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

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2020	Stück	63.134,738	EUR	64.553.471,11	EUR	1.022,47
2021	Stück	73.743,228	EUR	75.320.905,44	EUR	1.021,39
2022	Stück	38.641,128	EUR	39.468.003,92	EUR	1.021,40
30.06.2023	Stück	33.408,128	EUR	35.047.080,31	EUR	1.049,06

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes
Ausgegebene Anteile
Zurückgenommene Anteile

Stücke

38.641,128
476,000
-5.709,000

Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes

33.408,128

XAIA Credit Debt Capital

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

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2020	Stück	66.989,719	EUR	6.687.130,98	EUR	99,82
2021	Stück	64.389,525	EUR	6.415.463,30	EUR	99,64
2022	Stück	39.664,049	EUR	3.950.855,92	EUR	99,61
30.06.2023	Stück	39.605,757	EUR	4.041.525,90	EUR	102,04

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	39.664,049
Ausgegebene Anteile	6.931,122
Zurückgenommene Anteile	-6.989,414
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	39.605,757

XAIA Credit Debt Capital

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

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2020	Stück	456.060,610	EUR	45.948.907,62	EUR	100,75
2021	Stück	438.199,527	EUR	44.098.067,30	EUR	100,63
2022	Stück	456.840,240	EUR	45.966.342,73	EUR	100,62
30.06.2023	Stück	361.920,227	EUR	37.402.318,33	EUR	103,34

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	456.840,240
Ausgegebene Anteile	247,237
Zurückgenommene Anteile	-95.167,250
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	361.920,227

XAIA Credit Debt Capital

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

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2020	Stück	125.570,561	EUR	142.715.138,13	EUR	1.136,53
2021	Stück	127.800,561	EUR	146.381.191,64	EUR	1.145,39
2022	Stück	134.910,561	EUR	156.434.188,92	EUR	1.159,54
30.06.2023	Stück	135.580,561	EUR	161.476.524,63	EUR	1.191,00

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	134.910,561
Ausgegebene Anteile	748,000
Zurückgenommene Anteile	-78,000
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	135.580,561

XAIA Credit Debt Capital

XAIA Credit Debt Capital (R) Vergleichende Übersicht seit Auflegung

Geschäftsjahr	Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres		Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert am Ende des Geschäftsjahres	
2020 *)	Stück	14.471,000	EUR	1.451.524,66	EUR	100,31
2021	Stück	14.971,000	EUR	1.499.915,95	EUR	100,19
2022	Stück	29.777,000	EUR	2.980.242,17	EUR	100,09
30.06.2023	Stück	32.554,000	EUR	3.345.044,86	EUR	102,75

*) Auflagedatum 01.07.2020

Entwicklung des Anteilumlaufs im Berichtszeitraum

	Stücke
Anteilumlauf zu Beginn des Berichtszeitraumes	29.777,000
Ausgegebene Anteile	5.573,000
Zurückgenommene Anteile	-2.796,000
Anteilumlauf am Ende des Berichtszeitraumes	32.554,000

XAIA Credit

Anlagen

Anlage 1: Allgemeine Angaben

Risikokennzahlen

XAIA Credit - Debt Capital

Marktrisiko

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

Für den Betrachtungszeitraum vom 01. Januar 2023 bis zum 30. Juni 2023 wurden folgende Kennzahlen ermittelt:

Name	Marktrisikomessansatz	Limit	Niedrigste Auslastung	Höchste Auslastung	Durchschnittliche Auslastung	Auslastung (30.06.2023)
XAIA Credit - XAIA Credit Debt Capital	Absoluter VaR	2,200%	12,41%	19,72%	16,44%	15,20%

Grad der Hebelwirkung

Im Betrachtungszeitraum wurde ein Grad der Hebelwirkung von durchschnittlich 188,65% gemessen, wobei im Allgemeinen ein Grad der Hebelwirkung von 150,00% erwartet wird. Die Berechnung beruht auf der in der European Securities and Markets Authority (ESMA) - Leitlinie 10-788 definierten Sum-of-Notionals Methode. In diesem Zusammenhang ist ein Grad der Hebelwirkung von 0% als ungehebeltes Portfolio zu verstehen.

XAIA Credit - XAIA Credit Basis

Marktrisiko

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

Für den Betrachtungszeitraum vom 01. Januar 2023 bis zum 30. Juni 2023 wurden folgende Kennzahlen ermittelt:

Name	Marktrisikomessansatz	Limit	Niedrigste Auslastung	Höchste Auslastung	Durchschnittliche Auslastung	Auslastung (30.06.2023)
XAIA Credit - XAIA Credit Basis	Absoluter VaR	2,200%	7,75%	15,39%	9,35%	14,62%

Grad der Hebelwirkung

Im Betrachtungszeitraum wurde ein Grad der Hebelwirkung von durchschnittlich 221,34% gemessen, wobei im Allgemeinen ein Grad der Hebelwirkung von 170,00% erwartet wird. Die Berechnung beruht auf der in der European Securities and Markets Authority (ESMA) - Leitlinie 10-788 definierten Sum-of-Notionals Methode. In diesem Zusammenhang ist ein Grad der Hebelwirkung von 0% als ungehebeltes Portfolio zu verstehen.

XAIA Credit

Anlagen

Anlage 1: Allgemeine Angaben

Risikokennzahlen

XAIA Credit - XAIA Credit Basis II

Marktrisiko

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

Für den Betrachtungszeitraum vom 01. Januar 2023 bis zum 30. Juni 2023 wurden folgende Kennzahlen ermittelt:

Name	Marktrisikomessansatz	Limit	Niedrigste Auslastung	Höchste Auslastung	Durchschnittliche Auslastung	Auslastung (30.06.2023)
XAIA Credit - XAIA Credit Basis II	Absoluter VaR	2,200%	8,44%	13,52%	10,05%	13,52%

Grad der Hebelwirkung

Im Betrachtungszeitraum wurde ein Grad der Hebelwirkung von durchschnittlich 248,74% gemessen, wobei im Allgemeinen ein Grad der Hebelwirkung von 180,00% erwartet wird. Die Berechnung beruht auf der in der European Securities and Markets Authority (ESMA) - Leitlinie 10-788 definierten Sum-of-Notionals Methode. In diesem Zusammenhang ist ein Grad der Hebelwirkung von 0% als ungehebeltes Portfolio zu verstehen.

Anlagen

Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft

Nachfolgend sind die Angaben zur Mitarbeitervergütung (Stand 30. September 2022) aufgeführt:

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der Gesellschaft gezahlten Mitarbeitervergütung	14,86 Mio. EUR
- davon feste Vergütung	12,85 Mio. EUR
- davon variable Vergütung	2,01 Mio. EUR
Zahl der Mitarbeiter der Gesellschaft	156 Vollzeitäquivalent
Höhe des gezahlten Carried Interest	n/a
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der Gesellschaft gezahlten Vergütung an Risktaker	2,05 Mio. EUR
- davon Führungskräfte	1,67 Mio. EUR
- davon andere Risktaker	0,38 Mio. EUR

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

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

Gegenüber dem Vorjahr wurde keine Änderung des Vergütungssystems vorgenommen.

Vergütungspolitik des Portfoliomanagers

Nachfolgend sind die Angaben zur Mitarbeitervergütung (Stand 31. Dezember 2022) aufgeführt:

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der Gesellschaft gezahlten Mitarbeitervergütung	1,4 Mio. EUR
Zahl der Mitarbeiter der Gesellschaft	13 Vollzeitäquivalent

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

XAIA Credit

Anlagen

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

XAIA Credit Basis

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften

Wertpapierpensionsgeschäfte

		Pensionsgeschäfte	
Ertrags- und Kostenanteile			
Ertragsanteil des Fonds			
	absolut	EUR	2.026,61 *)
	in % der Bruttoerträge		100,00
Kostenanteil des Fonds		EUR	0,00
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft			
	absolut	EUR	0,00
	in % der Bruttoerträge		0,00
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft		EUR	0,00
Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent)			
	absolut	EUR	0,00
	in % der Bruttoerträge		100,00
Kostenanteil Dritter		EUR	2.026,61
Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps (absoluter			
		EUR	0,00

XAIA Credit

Anlagen

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

Angaben gemäß den ESMA-Leitlinien ESMA/2014/937

*) Aufteilung der Kosten und Erträge pro Gegenpartei:

J.P. Morgan SE (GD) Frankfurt (V)

EUR 2.026,61

XAIA Credit

Anlagen

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

XAIA Credit Basis II

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften

Wertpapierpensionsgeschäfte

		Pensionsgeschäfte	
Ertrags- und Kostenanteile			
Ertragsanteil des Fonds	absolut	EUR	4.728,76 *)
	in % der Bruttoerträge		100,00
Kostenanteil des Fonds		EUR	0,00
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft	absolut	EUR	0,00
	in % der Bruttoerträge		0,00
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft		EUR	0,00
Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent)	absolut	EUR	0,00
	in % der Bruttoerträge		100,00
Kostenanteil Dritter		EUR	4.728,76
Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps (absoluter Betrag)		EUR	0,00

XAIA Credit

Anlagen

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

Angaben gemäß den ESMA-Leitlinien ESMA/2014/937

*) Aufteilung der Kosten und Erträge pro Gegenpartei:

J.P. Morgan SE (GD) Frankfurt (V)

EUR 4.728,76

Anlagen

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

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

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impacts PAI) werden im Investitionsprozess auf AIFM-Ebene berücksichtigt.

Eine Berücksichtigung der PAI auf Ebene des (Teil-)Fonds ist nicht verbindlich und erfolgt insoweit nicht.

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