

Allianz PIMCO Corporate

ISIN: AT0000706494 (A)

ISIN: AT0000706502 (T)

Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH

Halbjahresbericht

vom 01.12.2021 – 31.05.2022

www.allianzinvest.at



Allgemeines zur Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH

Gesellschaft	Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH Hietzinger Kai 101-105, 1130 Wien Tel: 01/ 505 54 80; Fax: 01/ 505 54 81
Gründung	29. April 1991
Gesellschafter	Allianz Elementar Versicherungs AG
Aufsichtsrat	Mag. Rémi Vrignaud, Vorsitzender Dr. Kay Müller, stellvertretender Vorsitzender Mag. Susanne Althaler Wolfgang Jerabek (Mitarbeitervertreter) Mag. Daniel Planer (Mitarbeitervertreter)
Geschäftsführung	Mag. Sonja König Martin Bruckner (bis 31.12.2021) Mag. Andreas Witzani (ab 01.01.2022)
Prokuristen	Mag. Doris Kals Mag. Anton Kuzmanoski Mag. Jan Fellmayer Mag. Ivo Kreuzeder, LL.M. Michael Kocher Mag. Markus Reidlinger
Staatskommissär Staatskommissärstellvertreter	Mag. Heidrun Zanetta Mag. Christoph Kreutler
Prüfer	KPMG Austria GmbH Wirtschaftsprüfungs- und Steuerberatungsgesellschaft
Depotbank	Erste Group Bank AG

Darstellung der Fondsdaten zum Berichtsstichtag:

Fondsdaten in EUR	per 30.11.2021	per 31.05.2022
Fondsvolumen gesamt	130.729.176,91	119.294.986,87
Errechneter Wert je Ausschüttungsanteil	48,46	44,34
Ausgabepreis je Ausschüttungsanteil	50,40	46,11
Errechneter Wert je Thesaurierungsanteil	86,55	80,75
Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil	90,01	83,98
Ausschüttung/Auszahlung in EUR		per 01.02.2022
Ausschüttung je Ausschüttungsanteil		1,0000
Auszahlung je Thesaurierungsanteil		0,3098

Umlaufende Anteile zum Berichtsstichtag:

Ausschüttungsanteile	2.599.252,950
Thesaurierungsanteile	50.726,358
Gesamt umlaufende Anteile per 31.05.2022	2.649.979,308

Überblick über die ausgewiesenen Erträge und Fondsentwicklung der letzten Rechnungsjahre in EUR:

Datum	Fonds- vermögen gesamt	Errechneter Wert je Ausschüttungs- anteil	Ausschüttung je Anteil	Anteile	Wertent- wicklung in %
14.09.19	132.332.961,51	48,05	1,0000	2.498.776	17,08
14.09.20	150.516.478,92	46,91	1,0000	2.694.263	-0,31
30.11.20	145.323.409,08	46,39	0,0492	2.752.377	-
30.11.21	130.729.176,91	48,46	1,0000	2.599.496,344	4,58
31.05.22	119.294.986,87	44,34	-	2.599.252,950	-

Datum	Errechne je anteil	Zur Thesaurierung verwendeter Betrag	Auszahlung je Anteil	Anteile	Wertent- wicklung in %
14.09.19	84,04	2,92	0,8877	146.011	17,10
14.09.20	82,89	3,34	0,8851	291.042	-0,32
30.11.20	82,85	0,29	0,0879	213.004	-
30.11.21	86,55	0,82	0,3098	54.946,221	4,58
31.05.22	80,75	-	-	50.726,358	-

Anteilswertermittlung und Wertpapierbewertung

Der Wert eines Anteiles ergibt sich aus der Teilung des Gesamtwertes des Investmentfonds einschließlich der Erträge durch die Zahl der Anteile. Der Gesamtwert des Investmentfonds ist aufgrund der jeweiligen Kurswerte der zu ihm gehörigen Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Bezugsrechte zuzüglich des Wertes der zum Fonds gehörenden Finanzanlagen, Geldbeträge, Guthaben, Forderungen und sonstigen Rechte abzüglich Verbindlichkeiten, von der Depotbank zu ermitteln.

Das Nettovermögen wird nach folgenden Grundsätzen ermittelt:

- a) Der Wert von Vermögenswerten, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, wird grundsätzlich auf der Grundlage des letzten verfügbaren Kurses ermittelt, welcher bei der letzten Preisberechnung vor dem Stichtag verwendet wurde.
- b) Sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für einen Vermögenswert, welcher an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird, der Kurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, wird auf die Kurse zuverlässiger Datenprovider oder alternativ auf Marktpreise gleichartiger Wertpapiere oder andere anerkannte Bewertungsmethoden zurückgegriffen.

Es besteht das Risiko, dass aufgrund von Kursbildungen auf illiquiden Märkten die Bewertungskurse bestimmter Wertpapiere von ihren tatsächlichen Veräußerungen abweichen können (Bewertungsrisiko).

Berechnung des Gesamtrisikos

Die Berechnung des Gesamtrisikos erfolgt nach dem Commitment Approach.

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps

Wertpapierleihegeschäfte im Sinne der VO (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen laut Prospekt für den Fonds nicht eingesetzt werden. Wertpapierleihegeschäfte wurden deshalb nicht eingesetzt.

Pensionsgeschäfte im Sinne der VO (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen laut Prospekt für den Fonds eingesetzt werden. Im Rechnungsjahr wurden keine Pensionsgeschäfte durchgeführt.

Total Return Swaps (Gesamtrendite-Swaps) im Sinne der VO (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen laut Prospekt für den Fonds nicht eingesetzt werden. Total Return Swaps wurden deshalb nicht eingesetzt.

Vermögensaufstellung des Allianz PIMCO Corporate per 31. Mai 2022

Fondsvermögen einschliesslich Veränderungen und aufgelöste Positionen									
ISIN	Zinssatz	Wertpapier	Währung	Bestand	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil
ANLEIHEN									
ANLEIHEN US DOLLAR									
US00217GAB95	3,2500	APTV 3 1/4 03/01/32	USD	100.000	100.000		88,927000	82.500,23	0,07
US015271AY59	2,9500	ARE 2.95 03/15/34	USD	100.000	100.000		88,703000	82.292,42	0,07
US06051GKK49	2,9720	BAC 2.972 02/04/33	USD	1.200.000	1.200.000		89,654000	998.096,30	0,84
US06051GKQ19	4,5710	BAC 4.571 04/27/33	USD	300.000	300.000		102,117000	284.210,97	0,24
US100743AM53	3,7570	NGGLN 3.757 03/16/32	USD	200.000	200.000		95,849000	177.843,96	0,15
US11135FBV22	4,9260	AVGO 4.926 05/15/37	USD	163.000	164.000		95,290000	144.097,50	0,12
US12661PAC32	4,2500	CSLAU 4 1/4 04/27/32	USD	100.000	100.000		100,614000	93.342,61	0,08
US161175CL69	5,5000	CHTR 5 1/2 04/01/63	USD	100.000	100.000		90,026000	83.519,81	0,07
US172967NN71	3,7850	C 3.785 03/17/33	USD	300.000	300.000		94,943000	264.244,36	0,22
US172967NU15	4,9100	C 4.91 05/24/33	USD	200.000	200.000		102,372200	192.451,99	0,16
US21036PBL13	4,7500	STZ 4 3/4 05/09/32	USD	200.000	200.000		102,349000	189.904,44	0,16
US22966RAH93	2,2500	CUBE 2 1/4 12/15/28	USD	300.000			88,340000	245.866,96	0,21
US25179MBC64	5,2500	DVN 5 1/4 09/15/24	USD	32.000	32.000		103,903000	30.846,05	0,03
US256141AB88	4,5000	DOCTOR 4 1/2 01/18/32	USD	200.000	200.000		89,929000	166.859,63	0,14
US303075AA30	2,9000	FDS 2.9 03/01/27	USD	100.000	100.000		95,842000	88.915,48	0,07
US345397C270	4,9500	F 4.95 05/28/27	USD	400.000	400.000		99,520000	369.310,70	0,31
US36264FAD33	3,6250	HALEON 3 5/8 03/24/32	USD	250.000	250.000		96,160000	223.026,25	0,19
US373334KQ30	4,7000	SO 4.7 05/15/32	USD	500.000	500.000		103,318000	479.255,96	0,40
US38141GZE78	1,2170	GS 1.217 12/06/23	USD	300.000	300.000		97,987000	272.716,39	0,23
US38141GZM94	3,1020	GS 3.102 02/24/33	USD	600.000	600.000		89,838000	500.072,36	0,42
US38141GZN77	3,4360	GS 3.436 02/24/43	USD	500.000	500.000		85,453000	396.386,49	0,33
US38141GZR81	3,6150	GS 3.615 03/15/28	USD	200.000	200.000		97,765000	181.399,02	0,15
US38239PAA57	4,6250	GMGAU 4 5/8 05/04/32	USD	300.000	300.000		100,482000	279.660,45	0,23
US404119CM95	4,3750	HCA 4 3/8 03/15/42	USD	500.000	500.000		89,133000	413.503,11	0,35
US444859BT81	3,7000	HUM 3.7 03/23/29	USD	300.000	300.000		98,057000	272.911,22	0,23
US45866FAV67	4,3500	ICE 4.35 06/15/29	USD	200.000	200.000		101,612000	188.536,97	0,16
US46647PDC77	4,5860	JPM 4.586 04/26/33	USD	300.000	300.000		102,937000	286.493,18	0,24
US48255GAA31	4,8500	KKR 4.85 05/17/32	USD	300.000	300.000		102,493000	285.257,45	0,24
US55336VBT61	4,9500	MPLX 4.95 03/14/52	USD	300.000	300.000		92,467000	257.353,19	0,22
US55903VAN38	5,0500	WBD 5.05 03/15/42	USD	200.000	200.000		91,100000	169.032,38	0,14
US58933YBD67	1,9000	MRK 1.9 12/10/28	USD	600.000	600.000		91,708000	510.481,49	0,43
US61747YEL56	2,9430	MS 2.943 01/21/33	USD	300.000	300.000		89,984000	250.442,53	0,21
US62954HBB33	5,0000	NXPI 5 01/15/33	USD	200.000	200.000		100,728000	186.896,74	0,16
US71643VAB18	6,7000	PEMEX 6.7 02/16/32	USD	594.000	594.000		87,843000	484.077,76	0,41
US74365PAH10	4,1930	PRXNA 4.193 01/19/32	USD	200.000	200.000		84,932000	157.587,90	0,13
US74456QJC31	3,1000	PEG 3.1 03/15/32	USD	100.000	100.000		94,489000	87.660,27	0,07
US87612GAA94	4,2000	TRGP 4.2 02/01/33	USD	100.000	100.000		95,812000	88.887,65	0,07
US902613AL27	3,1790	UBS 3.179 02/11/43	USD	200.000	200.000		80,282000	148.960,01	0,12
US912810TD00	2,2500	T 2 1/4 02/15/52	USD	2.200.000	2.200.000		85,460938	1.744.262,58	1,46
US91282CEP23	2,8750	T 2 7/8 05/15/32	USD	1.500.000	1.500.000		101,179688	1.408.011,24	1,18
US92343VGP31	3,8750	VZ 3 7/8 03/01/52	USD	400.000	400.000		90,917000	337.385,66	0,28
US92564RAJ41	5,7500	VICI 5 3/4 02/01/27	USD	100.000	100.000		101,072000	93.767,51	0,08
US92564RAK14	4,5000	VICI 4 1/2 01/15/28	USD	200.000	200.000		94,190000	174.765,75	0,15
US95000U2U64	3,3500	WFC 3.35 03/02/33	USD	300.000	300.000		93,245000	259.518,51	0,22
US95000U2Z51	4,6110	WFC 4.611 04/25/53	USD	400.000	400.000		99,762000	370.208,74	0,31
SUMME NEUEMISSION							14.002.822,17	11,74	

ANLEIHEN

ANLEIHEN US DOLLAR

US00135TAB08	4,2630	AIB 4.263 04/10/25	USD	200.000			99,754000	185.089,53	0,16
US00205GAD97	4,2500	APAAU 4 1/4 07/15/27	USD	250.000			99,940000	231.793,30	0,19
US00206RLJ94	3,5500	T 3.55 09/15/55	USD	575.000			80,516000	429.508,30	0,36
US00206RLV23	3,6500	T 3.65 09/15/59	USD	800.000			80,492000	597.398,65	0,50
US00287YBD04	4,8750	ABBV 4 7/8 11/14/48	USD	100.000			103,083000	95.633,18	0,08
US00287YBV02	2,9500	ABBV 2.95 11/21/26	USD	200.000			97,681000	181.243,16	0,15
US00507VAN91	4,5000	ATVI 4 1/2 06/15/47	USD	100.000			102,516000	95.107,15	0,08
US00774MAE57	3,8750	AER 3 7/8 01/23/28	USD	150.000			93,425000	130.009,74	0,11
US00774MAL90	4,4500	AER 4.45 04/03/26	USD	200.000			98,172000	182.154,19	0,15
US00774MAT27	1,1500	AER 1.15 10/29/23	USD	300.000			96,197000	267.734,48	0,22
US00775PAA57	6,5000	ADVSAL 6 1/2 11/15/28	USD	100.000			88,744000	82.330,46	0,07
US00908PAC14	3,7000	ACACN 3.7 01/15/26	USD	300.000			96,339000	176.270,23	0,15
US00928QAS03	4,2500	AYR 4 1/4 06/15/26	USD	200.000			95,926000	177.986,83	0,15
US01166VAA70	4,8000	ALK 4.8 08/15/27	USD	100.000			100,007000	81.870,25	0,07
US01400EAC75	3,8000	ALCSW 3.8 09/23/49	USD	200.000			84,146000	156.129,51	0,13
US015271AU38	4,9000	ARE 4.9 12/15/30	USD	100.000			104,196000	96.665,74	0,08
US01748NAE40	3,5500	ALLE 3.55 10/01/27	USD	100.000			95,391000	88.497,08	0,07
US02005NBL38	1,4500	ALLY 1.45 10/02/23	USD	200.000			97,945000	181.733,00	0,15
US02109TAD46	4,6500	ALRSRU 4.65 04/09/24	USD	300.000			15,080000	41.970,50	0,04
US02342TAE91	2,5380	DOX 2.538 06/15/30	USD	300.000			86,500000	240.745,89	0,20
US023765AA88	3,2000	AAL 3.2 06/15/28	USD	100.000			91,425000	64.843,13	0,05
US02376AAA79	3,3500	AAL 3.35 10/15/29	USD	100.000			93,303000	67.820,67	0,06
US023771R919	3,0000	AAL 3 10/15/28	USD	100.000			90,764000	62.882,81	0,05
US023772AB21	4,0000	AAL 4 07/15/25	USD	300.000			91,088000	115.450,02	0,10
US02378MAA99	3,5000	AAL 3 1/2 02/15/32	USD	100.000			86,373000	71.442,39	0,06
US02401LAA26	3,3750	AAT 3 3/8 02/01/31	USD	200.000			89,064000	165.254,66	0,14
US024836AG36	3,8750	ACC 3 7/8 01/30/31	USD	100.000			101,634000	94.288,90	0,08
US025932AK06	3,5000	AFG 3 1/2 08/15/26	USD	300.000			101,885000	283.565,27	0,24
US02666TAB35	4,9000	AMH 4.9 02/15/29	USD	100.000			101,998000	94.626,59	0,08
US03027XAM20	3,1250	AMT 3 1/8 01/15/27	USD	100.000			95,460000	88.561,09	0,07
US03027XAY67	3,7000	AMT 3.7 10/15/49	USD	700.000			80,743000	524.353,84	0,44
US03027XBC39	2,1000	AMT 2.1 06/15/30	USD	400.000	400.000		83,375000	309.397,90	0,26
US031162BZ23	4,4000	AMGN 4.4 05/01/45	USD	200.000			96,452000	178.962,80	0,15
US03522AAJ97	4,9000	ABIBB 4.9 02/01/46	USD	400.000			100,701000	373.693,29	0,31
US03523TBV98	5,5500	ABIBB 5.55 01/23/49	USD	100.000			110,558000	102.567,96	0,09
US035240AN09	4,6000	ABIBB 4.6 04/15/48	USD	400.000			97,559000	362.033,58	0,30
US035240AQ30	4,7500	ABIBB 4 3/4 01/23/29	USD	300.000			104,707000	291.419,43	0,24
US037833CD08	3,8500	AAPL 3.85 08/04/46	USD	600.000			97,035000	540.133,59	0,45
US03939AAA51	3,6350	ACGL 3.635 06/30/50	USD	125.000			83,885000	97.278,27	0,08
US04015KAB61	3,2500	ARES 3 1/4 06/15/30	USD	100.000			92,018000	85.367,84	0,07

US042735BF63	3,8750	ARW 3 7/8 01/12/28	USD	500.000		98,138000	455.227,76	0,38
US042735BG47	3,2500	ARW 3 1/4 09/08/24	USD	100.000		99,082000	91.921,33	0,08
US04621WAD20	3,1500	AGO 3.15 06/15/31	USD	50.000		90,241000	41.859,63	0,04
US05329WAM47	4,5000	AN 4 1/2 10/01/25	USD	500.000		102,125000	473.722,05	0,40
US05351WAB90	3,8000	AGR 3.8 06/01/29	USD	800.000		97,858000	726.286,30	0,61
US05367AAH68	4,8750	ACGCAP 4 7/8 10/01/25	USD	500.000		99,913000	463.461,36	0,39
US05401AAK79	5,5000	AVOL 5 1/2 01/15/26	USD	100.000		101,036000	93.734,11	0,08
US05401AAR23	2,5280	AVOL 2.528 11/18/27	USD	258.000		86,619000	207.326,30	0,17
US054561AJ49	4,3500	EQH 4.35 04/20/28	USD	100.000		100,654000	93.379,72	0,08
US05526DBB01	3,5570	BATSLN 3.557 08/15/27	USD	400.000		94,818000	351.861,95	0,29
US05533UAD00	4,3750	BBVASM 4 3/8 04/10/24	USD	300.000		100,417000	279.479,54	0,23
US056752AN88	4,8750	BIDU 4 7/8 11/14/28	USD	400.000		102,131000	378.999,91	0,32
US05723KAF75	4,0800	BHI 4.08 12/15/47	USD	700.000		90,847000	589.970,31	0,49
US05970FAC59	2,7000	BSANCI 2.7 01/10/25	USD	200.000		95,902000	177.942,30	0,15
US060505FQ25	4,3000	BAC 4.3 PERP	USD	300.000		90,388000	251.566,94	0,21
US06051GGT04	3,0930	BAC 3.093 10/01/25	USD	600.000		98,735000	549.596,44	0,46
US06051GHG73	3,9700	BAC 3.97 03/05/29	USD	500.000		98,527000	457.032,19	0,38
US06051GKA66	2,2990	BAC 2.299 07/21/32	USD	300.000		85,097000	236.841,08	0,20
US06279JAA79	4,5000	BKIR 4 1/2 11/25/23	USD	300.000		101,108000	281.402,73	0,24
US067316AD11	2,7500	BACARD 2 3/4 07/15/26	USD	300.000		94,497000	263.003,06	0,22
US067316AE93	4,4500	BACARD 4.45 05/15/25	USD	400.000		100,903000	374.442,90	0,31
US06738EBD67	4,9720	BACR 4.972 05/16/29	USD	600.000		101,558000	565.310,33	0,47
US09256BAM90	3,5000	BX 3 1/2 09/10/49	USD	300.000		83,385000	232.076,26	0,19
US09261BAA89	1,6000	BX 1.6 03/30/31	USD	100.000		81,578000	75.682,35	0,06
US09261HAG20	2,3500	BCRED 2.35 11/22/24	USD	200.000		94,100000	174.598,76	0,15
US09261XAB82	2,7500	BXSL 2 3/4 09/16/26	USD	300.000		91,324000	254.172,00	0,21
US09581JAA43	3,1250	OWL 3 1/8 06/10/31	USD	500.000		80,643000	374.074,59	0,31
US09659W2K94	3,0520	BNP 3.052 01/13/31	USD	200.000	200.000	89,017000	165.167,46	0,14
US09659W2M50	1,9040	BNP 1.904 09/30/28	USD	400.000		87,345000	324.130,25	0,27
US105340AQ63	3,9500	BDN 3.95 11/15/27	USD	200.000		97,251000	180.445,31	0,15
US10553YAF25	6,4500	BRASKM 6.45 02/03/24	USD	400.000		104,827000	389.004,55	0,33
US10922NAF06	4,7000	BHF 4.7 06/22/47	USD	33.000		85,760000	26.255,50	0,02
US110122DE50	3,9000	BMV 3.9 02/20/28	USD	200.000		101,908000	189.086,19	0,16
US11042TAA16	3,8000	IAGLN 3.8 09/20/31	USD	100.000		95,260000	68.623,89	0,06
US11043HAA68	4,1250	IAGLN 4 1/8 09/20/31	USD	200.000		91,296000	132.117,15	0,11
US11043XAA19	3,3000	IAGLN 3.3 12/15/32	USD	200.000		91,001000	156.811,74	0,13
US111021AE12	9,6250	BRITEL 9 5/8 12/15/30	USD	200.000		130,849000	242.785,04	0,20
US11120VAA17	3,8500	BRX 3.85 02/01/25	USD	250.000		100,182000	232.354,58	0,19
US11135FAQ46	4,1500	AVGO 4.15 11/15/30	USD	121.000		95,221000	106.890,63	0,09
US11135FAS02	4,3000	AVGO 4.3 11/15/32	USD	100.000		95,282000	88.395,96	0,07
US11135FBF71	2,6000	AVGO 2.6 02/15/33	USD	100.000		80,978000	75.125,71	0,06
US11135FBL40	3,4690	AVGO 3.469 04/15/34	USD	710.000		85,673000	564.317,93	0,47
US11135FBP53	3,1370	AVGO 3.137 11/15/35	USD	290.000		81,249000	218.593,65	0,18
US11135FBQ37	3,1870	AVGO 3.187 11/15/36	USD	215.000		81,207000	161.977,04	0,14
US11271LAB80	4,7000	BAMACN 4.7 09/20/47	USD	300.000		95,010000	264.430,84	0,22
US1248EPL57	4,5000	CHTR 4 1/2 06/01/33	USD	600.000		87,941000	489.512,94	0,41
US125491AP51	4,1000	CIXCN 4.1 06/15/51	USD	100.000		73,848000	68.510,99	0,06
US126117AV22	3,9000	CNA 3.9 05/01/29	USD	200.000		96,958000	179.901,66	0,15
US126650CX62	4,3000	CVS 4.3 03/25/28	USD	350.000		101,631000	330.001,39	0,28
US126650DG21	3,2500	CVS 3 1/4 08/15/29	USD	200.000		94,943000	176.162,91	0,15
US12665UAA25	4,7040	CVSPAS 4.704 01/10/36	USD	400.000		99,457000	271.393,98	0,23
US133434AD26	3,7010	CAMLNG 3.701 01/15/39	USD	200.000		89,671000	166.380,93	0,14
US136385AL51	6,2500	CNQC�N 6 1/4 03/15/38	USD	100.000		112,012000	103.916,88	0,09
US138616AE73	4,8750	CANTOR 4 7/8 05/01/24	USD	200.000		102,376000	189.954,54	0,16
US142339AJ92	2,7500	CSL 2 3/4 03/01/30	USD	400.000		98,068000	330.524,17	0,28
US14314DAA19	3,5000	CG 3 1/2 09/19/29	USD	100.000		94,595000	87.758,60	0,07
US15236FAB67	4,6250	ELEBRA 4 5/8 02/04/30	USD	200.000		88,769000	164.707,30	0,14
US161175BJ23	3,7500	CHTR 3 3/4 02/15/28	USD	500.000		95,325000	442.179,24	0,37
US161175BL78	5,3750	CHTR 5 3/8 05/01/47	USD	300.000		92,233000	256.701,92	0,22
US161175BT05	4,8000	CHTR 4.8 03/01/50	USD	500.000		85,364000	395.973,65	0,33
US161175CE27	3,5000	CHTR 3 1/2 03/01/42	USD	50.000		76,189000	35.341,40	0,03
US172967ML25	2,6660	C 2.666 01/29/31	USD	500.000		88,957000	412.640,32	0,35
US172967MY46	2,5610	C 2.561 05/01/32	USD	500.000		86,596000	401.688,47	0,34
US177376AF70	3,3000	CTXS 3.3 03/01/30	USD	400.000		99,573000	369.507,38	0,31
US18551PAC32	3,7430	CNL 3.743 05/01/26	USD	700.000		98,150000	637.396,79	0,53
US20030NDH17	3,7500	CMCSA 3 3/4 04/01/40	USD	300.000		93,030000	258.920,12	0,22
US20030NDT54	2,9370	CMCSA 2.937 11/01/56	USD	1.146.000		75,572000	803.465,18	0,67
US209111FW83	3,7000	ED 3.7 11/15/59	USD	400.000		83,422000	309.572,32	0,26
US212015AT84	5,7500	CLR 5 3/4 01/15/31	USD	200.000		103,417000	191.886,07	0,16
US22160NAA72	2,8000	CSGP 2.8 07/15/30	USD	100.000	200.000	87,157000	80.858,15	0,07
US224044CL98	1,8000	COXENT 1.8 10/01/30	USD	100.000		82,368000	76.415,25	0,06
US225401AD03	2,9970	CS 2.997 12/14/23	USD	700.000		99,775000	647.949,72	0,54
US225401AF50	3,8690	CS 3.869 01/12/29	USD	400.000		94,024000	348.915,48	0,29
US225401AM02	2,5930	CS 2.593 09/11/25	USD	400.000		95,794000	355.483,81	0,30
US22822VAC54	3,7000	CCI 3.7 06/15/26	USD	100.000		99,137000	91.972,35	0,08
US22822VAG68	3,2000	CCI 3.2 09/01/24	USD	500.000		99,613000	462.069,77	0,39
US22822VAH42	3,6500	CCI 3.65 09/01/27	USD	200.000		97,884000	181.619,82	0,15
US22822VAL53	4,3000	CCI 4.3 02/15/29	USD	100.000		99,319000	92.141,20	0,08
US22822VAQ41	4,1500	CCI 4.15 07/01/50	USD	200.000		88,912000	164.972,63	0,14
US22822VAR24	3,3000	CCI 3.3 07/01/30	USD	100.000		91,978000	85.330,74	0,07
US22822VAU52	3,2500	CCI 3 1/4 01/15/51	USD	200.000		76,293000	141.558,59	0,12
US23302JAA34	3,7500	DUBAEE 3 3/4 02/15/26	USD	300.000		95,262000	265.132,20	0,22
US23345MAA53	4,1250	DTMINC 4 1/8 06/15/29	USD	100.000		95,143000	88.267,00	0,07
US23345MAB37	4,3750	DTMINC 4 3/8 06/15/31	USD	100.000		93,902000	87.115,69	0,07
US24703TAB26	4,0000	DELL 4 07/15/24	USD	300.000		101,328000	282.015,03	0,24
US24703TAC09	5,8500	DELL 5.85 07/15/25	USD	700.000		105,420000	684.608,96	0,57
US24703TAD81	6,0200	DELL 6.02 06/15/26	USD	100.000		106,015000	98.353,28	0,08
US24703TAE64	4,9000	DELL 4.9 10/01/26	USD	300.000		102,472000	285.199,00	0,24
US247361ZV38	2,0000	DAL 2 06/10/28	USD	100.000		90,093000	76.085,41	0,06
US247361ZX93	7,0000	DAL 7 05/01/25	USD	59.000		107,304000	58.733,98	0,05
US247361ZZ42	7,3750	DAL 7 3/8 01/15/26	USD	111.000		108,594000	111.827,94	0,09
US25278XAR08	3,1250	FANG 3 1/8 03/24/31	USD	300.000		91,595000	254.926,25	0,21
US254687FW18	2,2000	DIS 2.2 01/13/28	USD	800.000		93,488000	693.852,86	0,58
US26884UAB52	4,5000	EPR 4 1/2 04/01/25	USD	100.000		99,733000	92.525,28	0,08
US269246BQ61	3,8000	MS 3.8 08/24/27	USD	200.000		99,213000	184.085,72	0,15
US278642AU75	3,6000	EBAY 3.6 06/05/27	USD	100.000		99,176000	92.008,54	0,08
US278642AV58	1,9000	EBAY 1.9 03/11/25	USD	100.000		95,560000	88.653,86	0,07
US29082HAA05	5,0500	EMBRBZ 5.05 06/15/25	USD	200.000		101,009000	187.418,13	0,16
US292480AL49	4,9500	ET 4.95 05/15/28	USD	250.000		101,180000	234.669,26	0,20
US29250NAW56	6,2500	ENBCN 6 1/4 03/01/2078	USD	300.000		97,223000	270.590,04	0,23
US29273RAP47	6,0500	ET 6.05 06/01/41	USD	500.000		102,869000	477.173,21	0,40
US29278NAG88	5,2500	ET 5 1/4 04/15/29	USD	100.000		103,773000	96.273,31	0,08
US29364GAJ22	2,9500	ETR 2.95 09/01/26	USD	300.000		96,945000	269.816,31	0,23

US29365TAJ34	3,5500	ETR 3.55 09/30/49	USD	400.000		84,342000	312.986,36	0,26
US29379VAY92	4,4500	EPD 4.45 02/15/43	USD	303.000		92,691000	260.556,39	0,22
US29379VBZ58	3,9500	EPD 3.95 01/31/60	USD	400.000		83,726000	310.700,44	0,26
US294429AL98	3,2500	EFX 3 1/4 06/01/26	USD	300.000		97,250000	270.665,18	0,23
US29444UBD72	2,9000	EQIX 2.9 11/18/26	USD	100.000		95,188000	88.308,75	0,07
US29444UBH86	2,1500	EQIX 2.15 07/15/30	USD	200.000		84,450000	156.693,57	0,13
US29670GAF90	2,4000	WTRG 2.4 05/01/31	USD	200.000		86,323000	160.168,85	0,13
US29717PAP27	3,5000	ESS 3 1/2 04/01/25	USD	400.000		99,955000	370.924,95	0,31
US30161MAJ27	5,7500	CEG 5 3/4 10/01/41	USD	200.000		101,009000	187.418,13	0,16
US30161NAX93	4,0500	EXC 4.05 04/15/30	USD	200.000		99,052000	183.786,99	0,15
US30212PAP09	3,8000	EXPE 3.8 02/15/28	USD	600.000		96,247000	535.747,29	0,45
US302635AJ69	1,6500	FSK 1.65 10/12/24	USD	200.000		92,719000	172.036,37	0,14
US303901BB79	4,8500	FFHCN 4.85 04/17/28	USD	100.000		101,462000	94.129,33	0,08
US31428XBS45	4,9500	FDX 4.95 10/17/48	USD	200.000		99,896000	185.353,00	0,16
US31428XBV73	3,1000	FDX 3.1 08/05/29	USD	100.000		94,007000	87.213,10	0,07
US31847RAF91	4,6000	FAF 4.6 11/15/24	USD	375.000		102,222000	355.629,00	0,30
US337738AR95	4,2000	FISV 4.2 10/01/28	USD	100.000		99,459000	92.271,08	0,08
US33938EAU10	4,7500	FLEX 4 3/4 06/15/25	USD	400.000		102,131000	378.999,91	0,32
US34531XAC83	2,8150	FRDFND 2.815 06/01/70	USD	100.000		72,182000	66.965,40	0,06
US34960PAB76	6,5000	FTAI 6 1/2 10/01/25	USD	200.000		96,860000	179.719,83	0,15
US35137LAK17	5,5760	FOXA 5.576 01/25/49	USD	300.000	100.000	104,374000	290.492,62	0,24
US35805BAB45	2,3750	FMEGR 2 3/8 02/16/31	USD	200.000		83,168000	154.314,87	0,13
US361448AY97	3,2500	GMT 3 1/4 09/15/26	USD	100.000		97,149000	90.128,03	0,08
US36164QNA21	4,4180	GE 4.418 11/15/35	USD	321.000	273.000	99,712000	296.943,61	0,25
US361841AJ81	5,2500	GLPI 5 1/4 06/01/25	USD	100.000		100,361000	93.107,89	0,08
US361841AK54	5,7500	GLPI 5 3/4 06/01/28	USD	100.000		101,842000	94.481,86	0,08
US361841AP42	4,0000	GLPI 4 01/15/30	USD	200.000		91,652000	170.056,59	0,14
US36186CBY84	8,0000	ALLY 8 11/01/31	USD	300.000		118,527000	329.883,11	0,28
US363576AB52	3,5000	AJG 3 1/2 05/20/51	USD	200.000		80,815000	149.948,97	0,13
US36962GXZ26	6,7500	GE 6 3/4 03/15/32	USD	62.000	53.000	117,399000	67.527,03	0,06
US37045XCR52	5,1000	GM 5.1 01/17/24	USD	100.000		102,493000	95.085,82	0,08
US37940XAB82	3,2000	GPN 3.2 08/15/29	USD	100.000		91,241000	84.647,00	0,07
US37940XAD49	2,9000	GPN 2.9 05/15/30	USD	100.000		88,501000	82.105,02	0,07
US38141GYC22	3,2100	GS 3.21 04/22/42	USD	500.000	500.000	83,064000	385.304,76	0,32
US38141GYJ74	2,3830	GS 2.383 07/21/32	USD	200.000		85,033000	157.775,30	0,13
US38148LAE65	3,7500	GS 3 3/4 05/22/25	USD	350.000	150.000	101,001000	327.955,75	0,27
US39138QAA31	4,0470	GWOCN 4.047 05/17/28	USD	300.000		100,150000	278.736,43	0,23
US39530VAA61	5,5500	GRNKEN 5.55 01/29/25	USD	200.000		97,630000	181.148,53	0,15
US40427LAB09	10,1760	HSBC 10.176 PERP	USD	300.000		140,104000	389.935,99	0,33
US404280AU33	4,2500	HSBC 4 1/4 08/18/25	USD	600.000		100,856000	561.402,73	0,47
US413875AR63	3,8320	LHX 3.832 04/27/25	USD	100.000		100,334000	93.082,85	0,08
US42225UAG94	3,1000	HTA 3.1 02/15/30	USD	500.000		90,196000	418.387,61	0,35
US42250PAB94	2,8750	PEAK 2 7/8 01/15/31	USD	100.000		98,930000	83.430,74	0,07
US431282AR39	4,2000	HIW 4.2 04/15/29	USD	100.000		98,935000	91.784,95	0,08
US437076BD31	4,8750	HD 4 7/8 02/15/44	USD	300.000		107,453000	299.062,07	0,25
US44107TAV89	4,0000	HST 4 06/15/25	USD	100.000		99,560000	92.364,78	0,08
US44107TAX46	3,8750	HST 3 7/8 04/01/24	USD	100.000		100,104000	92.869,47	0,08
US44107TAY29	3,3750	HST 3 3/8 12/15/29	USD	100.000		90,694000	84.139,53	0,07
US44107TAZ93	3,5000	HST 3 1/2 09/15/30	USD	100.000		89,911000	83.413,12	0,07
US44409MAC01	3,2500	HPP 3 1/4 01/15/30	USD	200.000		90,808000	168.490,58	0,14
US44891ABV89	0,8750	HYNMTR 0 7/8 06/14/24	USD	300.000		94,633000	263.381,58	0,22
US452327AM11	2,5500	ILMN 2.55 03/23/31	USD	550.000		85,494000	436.234,34	0,37
US45262BAB99	3,5000	IMBLN 3 1/2 07/26/26	USD	200.000		95,674000	177.519,25	0,15
US45262BAC72	3,8750	IMBLN 3 7/8 07/26/29	USD	300.000		93,176000	259.326,47	0,22
US45834QAA76	3,8750	INTBAP 3 7/8 08/15/50	USD	100.000		91,453000	84.843,68	0,07
US45866FAK03	2,1000	ICE 2.1 06/15/30	USD	100.000		87,254000	80.948,14	0,07
US459506AQ49	2,3000	IFF 2.3 11/01/30	USD	200.000		85,760000	159.124,22	0,13
US46647PAR73	4,0050	JPM 4.005 04/23/29	USD	700.000		99,127000	643.741,53	0,54
US46647PBF27	2,3010	JPM 2.301 10/15/25	USD	700.000		96,892000	629.227,20	0,53
US477143AH41	2,7500	JBLU 2 3/4 05/15/32	USD	100.000		87,619000	72.366,67	0,06
US48128BAH42	4,0000	JPM 4 PERP	USD	600.000		87,395000	486.473,70	0,41
US482480AE03	4,6500	KLAC 4.65 11/01/24	USD	600.000		103,374000	575.418,87	0,48
US485170BA12	3,1250	KSU 3 1/8 06/01/26	USD	200.000		98,545000	182.846,28	0,15
US49427RAP73	3,0500	KRC 3.05 02/15/30	USD	100.000		89,544000	83.072,64	0,07
US494550AQ90	7,3000	KMI 7.3 08/15/33	USD	200.000		116,369000	215.917,99	0,18
US512807AW84	2,8750	LRCX 2 7/8 06/15/50	USD	200.000		78,795000	146.200,95	0,12
US517834AH06	2,9000	LVS 2.9 06/25/25	USD	200.000		92,092000	170.872,99	0,14
US52107QAG01	3,7500	LAZ 3 3/4 02/13/25	USD	400.000		99,915000	370.776,51	0,31
US524901AR65	5,6250	LM 5 5/8 01/15/44	USD	400.000		109,977000	408.115,78	0,34
US52532XAH89	2,3000	LDOS 2.3 02/15/31	USD	300.000		83,652000	232.819,37	0,20
US53944YAF07	4,4500	LLOYDS 4.45 05/08/25	USD	1,000.000		101,923000	945.570,09	0,79
US55336VAP58	4,9000	MPLX 4.9 04/15/58	USD	100.000		88,405000	82.015,96	0,07
US55336VBN91	4,2500	MPLX 4 1/4 12/01/27	USD	100.000		99,544000	92.349,94	0,08
US571900BB49	3,6000	MAR 3.6 04/15/24	USD	200.000		100,595000	186.649,97	0,16
US571903AX17	4,5000	MAR 4 1/2 10/01/34	USD	300.000		97,047000	270.100,19	0,23
US571903BE27	4,6250	MAR 4 5/8 06/15/30	USD	200.000		99,789000	185.154,47	0,16
US573874AF10	2,4500	MRVL 2.45 04/15/28	USD	800.000		90,171000	669.234,62	0,56
US58013MFK53	3,6250	MCD 3 5/8 09/01/49	USD	300.000		86,649000	241.160,59	0,20
US58547DAC39	5,6250	MPEL 5 5/8 07/17/27	USD	300.000		78,722000	219.098,25	0,18
US594918CD48	2,6750	MSFT 2.675 06/01/60	USD	200.000		77,878000	144.499,49	0,12
US595112BN21	5,3270	MU 5.327 02/06/29	USD	100.000		103,964000	96.450,51	0,08
US595112BQ52	4,6630	MU 4.663 02/15/30	USD	200.000		100,056000	185.649,87	0,16
US59523UAL17	3,7500	MAA 3 3/4 06/15/24	USD	300.000		101,031000	281.188,42	0,24
US59523UAN72	3,6000	MAA 3.6 06/01/27	USD	100.000		98,715000	91.580,85	0,08
US595620AW50	2,7000	BRKHEC 2.7 08/01/52	USD	1,000.000		76,982000	714.184,99	0,60
US59833CAA09	3,9000	MWXCAP 3.9 04/01/24	USD	300.000		99,699000	277.481,21	0,23
US606822BS23	1,4120	MUFG 1.412 07/17/25	USD	500.000		93,216000	432.396,33	0,36
US606822BW35	0,9530	MUFG 0.953 07/19/25	USD	600.000		94,507000	526.061,79	0,44
US60687YBH18	2,2010	MIZUHO 2.201 07/10/31	USD	500.000		84,263000	390.866,50	0,33
US61747YED31	2,2390	MS 2.239 07/21/32	USD	400.000		85,157000	316.010,76	0,26
US61772BAC72	3,2170	MS 3.217 04/22/42	USD	800.000		84,598000	627.872,72	0,53
US620076BL24	4,6000	MSI 4.6 02/23/28	USD	400.000		100,870000	374.320,44	0,31
US62828L2B85	4,4000	MUTHIN 4.4 09/02/23	USD	300.000		98,803000	274.987,48	0,23
US62944TAF21	3,0000	NVR 3 05/15/30	USD	200.000		89,857000	166.726,04	0,14
US63633DAF15	3,0000	NHI 3 02/01/31	USD	100.000		80,428000	74.615,46	0,06
US638612AM35	3,9000	NATMUT 3.9 11/30/49	USD	200.000		88,602000	82.198,72	0,07
US63861VAC19	4,3630	NWIDE 4.363 08/01/24	USD	300.000		100,987000	281.065,96	0,24
US64952GAQ10	4,4500	NYLIFE 4.45 05/15/69	USD	200.000		89,441000	165.954,17	0,14
US65120FAB04	5,7500	NCMAU 5 3/4 11/15/41	USD	100.000		103,777000	96.277,02	0,08
US65339KBK51	5,6500	NEE 5.65 05/01/2079	USD	200.000		93,310000	173.132,94	0,15
US654579AD34	5,1000	NIPLIF 5.1 10/16/44	USD	200.000		101,121000	187.625,94	0,16
US654744AD34	4,8100	NSANY 4.81 09/17/30	USD	300.000	300.000	94,896000	264.113,55	0,22
US65535HAQ20	3,1030	NOMURA 3.103 01/16/30	USD	400.000		89,668000	332.750,72	0,28

US65535HAY53	2,1720	NOMURA 2.172 07/14/28	USD	200.000				87,653000	162.636,61	0,14
US66775VAB18	4,0000	WMB 4 04/01/27	USD	300.000				99,783000	277.715,00	0,23
US67576GAD97	7,7200	ODEBRE 7.72 12/01/26	USD	253.696				22,554000	53.083,40	0,04
US68233JBH68	3,7000	ONCRTX 3.7 11/15/28	USD	600.000				100,298000	558.296,69	0,47
US682680AS26	4,0000	OKE 4 07/13/27	USD	300.000				99,756000	277.639,86	0,23
US682680AU71	4,5500	OKE 4.55 07/15/28	USD	600.000				100,486000	559.343,17	0,47
US682680AW38	4,3500	OKE 4.35 03/15/29	USD	300.000				98,157000	273.189,54	0,23
US68389XAM74	5,3750	ORCL 5 3/8 07/15/40	USD	300.000				97,277000	270.740,33	0,23
US68389XBQ79	4,0000	ORCL 4 11/15/47	USD	300.000				78,771000	219.234,62	0,18
US690742AF87	3,4000	OC 3.4 08/15/26	USD	300.000				99,278000	276.309,49	0,23
US6944PL2H11	1,6000	PACLIF 1.6 09/21/28	USD	200.000				86,174000	159.892,38	0,13
US70450YAJ29	3,2500	PYPL 3 1/4 06/01/50	USD	100.000				79,695000	73.935,43	0,06
US709599AZ77	3,9500	PENSKE 3.95 03/10/25	USD	300.000				100,348000	279.287,50	0,23
US71568QAC15	4,1250	PLNIJ 4 1/8 05/15/27	USD	200.000				98,231000	182.263,66	0,15
US71951QAA04	4,3000	DOC 4.3 03/15/27	USD	100.000				100,818000	93.531,87	0,08
US720186AN51	2,5000	DUK 2 1/2 03/15/31	USD	800.000				87,303000	647.948,79	0,54
US723787AB37	7,2000	PXD 7.2 01/15/28	USD	100.000				114,833000	106.534,00	0,09
US74251VAR33	3,7000	PF3 3.7 05/15/29	USD	100.000				98,136000	91.043,70	0,08
US74256LEP04	1,2500	PF3 1 1/4 08/16/26	USD	200.000				90,490000	167.900,55	0,14
US743674BE29	3,4000	PL 3.4 01/15/30	USD	300.000				93,735000	260.882,27	0,22
US74762EAF97	2,9000	PWR 2.9 10/01/30	USD	100.000				87,467000	81.145,75	0,07
US75508XAA46	2,7500	RYN 2 3/4 05/17/31	USD	100.000				87,165000	80.865,57	0,07
US75884RBA05	3,7000	REG 3.7 06/15/30	USD	100.000				94,233000	87.422,77	0,07
US759351AM18	3,9500	RGA 3.95 09/15/26	USD	400.000				100,935000	374.561,65	0,31
US75968NAD30	3,6000	RNR 3.6 04/15/29	USD	100.000				96,328000	89.366,36	0,07
US76169XAA28	2,1250	REXR 2 1/8 12/01/30	USD	100.000				84,103000	78.024,86	0,07
US775109BP56	3,7000	RCIGN 3.7 11/15/49	USD	500.000				81,863000	379.733,74	0,32
US77578JAB44	3,6250	ROLLS 3 5/8 10/14/25	USD	200.000				93,701000	173.858,43	0,15
US780097BG51	4,8920	NWG 4.892 05/18/29	USD	600.000				100,685000	560.450,88	0,47
US78410GAD60	3,8750	SBAC 3 7/8 02/15/27	USD	200.000				98,349000	182.482,61	0,15
US78432MAA36	5,1250	SECBEN 5 1/8 11/13/26	USD	100.000				100,339000	93.087,48	0,08
US78448TAE29	3,5500	SMBAC 3.55 04/15/24	USD	200.000				90,987000	183.647,83	0,15
US785592AJ58	5,7500	SPLLLC 5 3/4 05/15/24	USD	1.175.000				103,530000	1.128.562,48	0,95
US785592AV86	5,8750	SPLLLC 5 7/8 06/30/26	USD	100.000				105,930000	98.274,42	0,08
US78572XAG60	3,9000	SBRA 3.9 10/15/29	USD	300.000				93,390000	259.922,07	0,22
US797440BZ64	1,7000	SRE 1.7 10/01/30	USD	300.000				85,048000	236.704,70	0,20
US80007RAM79	2,5500	SANLTD 2.3 03/08/27	USD	300.000				79,344000	220.829,39	0,19
US80007RAP01	3,1000	SANLTD 2.85 03/08/29	USD	400.000				74,831000	277.691,81	0,23
US80007RAR66	3,2500	SANLTD 3 1/4 08/08/31	USD	400.000				70,150000	260.320,99	0,22
US80281LAA35	4,7500	SANUK 4 3/4 09/15/25	USD	200.000				100,595000	186.649,97	0,16
US80281LAM72	1,5320	SANUK 1.532 08/21/26	USD	700.000				91,749000	595.828,00	0,50
US80282KAE64	4,5000	SANUSA 4 1/2 07/17/25	USD	1.000.000				101,511000	941.747,84	0,79
US80282KAZ93	3,2440	SANUSA 3.244 10/05/26	USD	300.000				96,648000	268.989,70	0,23
US803014AA74	3,6490	STOAU 3.649 04/29/31	USD	200.000				87,297000	161.976,06	0,14
US81180WBD20	4,1250	STX 4 1/8 01/15/31	USD	300.000				90,867000	252.900,08	0,21
US816851BG34	3,4000	SRE 3.4 02/01/28	USD	300.000				97,541000	271.475,09	0,23
US817826AF77	2,5000	SVELEV 2 1/2 02/10/41	USD	200.000				72,456000	134.439,19	0,11
US830867AA59	4,5000	DAL 4 1/2 10/20/25	USD	100.000				100,130000	92.893,59	0,08
US83192PAA66	2,0320	SNLN 2.032 10/14/30	USD	100.000				82,771000	76.789,13	0,06
US836205BA15	4,8500	SOAF 4.85 09/30/29	USD	300.000				94,124000	261.964,93	0,22
US842400FZ13	4,6500	EIX 4.65 10/01/43	USD	100.000				94,862000	88.006,31	0,07
US842400GG23	4,0000	EIX 4 04/01/47	USD	600.000				86,070000	479.098,25	0,40
US842400GJ61	3,6500	EIX 3.65 03/01/28	USD	300.000				96,961000	269.860,84	0,23
US842400GN73	3,7000	EIX 3.7 08/01/25	USD	200.000				100,173000	185.866,96	0,16
US842587DJ36	3,7500	SO 3 3/4 09/15/51	USD	900.000				99,365000	746.159,20	0,63
US844741BJ60	5,2500	LUV 5 1/4 05/04/25	USD	300.000		100.000		104,559000	291.007,51	0,24
US84858XAA28	3,6500	SAVE 3.65 02/15/30	USD	200.000				89,119000	129.348,09	0,11
US84861TAG31	3,2000	SRC 3.2 02/15/31	USD	100.000				88,433000	82.041,93	0,07
US85205TAK60	4,6000	SPR 4.6 06/15/28	USD	300.000				82,955000	230.879,49	0,19
US85207UAH86	7,1250	S 7 1/8 06/15/24	USD	100.000				106,568000	98.866,31	0,08
US85207UAJ43	7,6250	S 7 5/8 02/15/25	USD	200.000				109,334000	202.864,83	0,17
US85208NAD21	4,7380	SPRNTS 4.738 03/20/25	USD	300.000				101,016000	210.860,01	0,18
US853254BN98	3,7850	STANLN 3.785 05/21/25	USD	300.000				99,646000	277.333,70	0,23
US853496AG21	4,3750	BMCAUS 4 3/8 07/15/30	USD	200.000				90,379000	167.694,59	0,14
US860630AG72	4,0000	SF 4 05/15/30	USD	100.000				96,385000	89.419,24	0,07
US862121AC45	2,7500	STOR 2 3/4 11/18/30	USD	100.000				85,723000	79.527,79	0,07
US863667AN16	3,5000	SYK 3 1/2 03/15/26	USD	300.000				100,098000	278.591,71	0,23
US86389QAF90	6,5000	STCITY 6 1/2 01/15/28	USD	200.000				69,125000	128.258,65	0,11
US86562MBW91	2,7500	SUMIBK 2 3/4 01/15/30	USD	400.000				89,694000	332.847,20	0,28
US86562MCB46	2,1300	SUMIBK 2.13 07/08/30	USD	500.000				84,869000	393.677,52	0,33
US87124VAF67	3,6250	SYDAU 3 5/8 04/28/26	USD	400.000				98,336000	364.916,97	0,31
US87162WAE03	1,7500	SNX 1 3/4 08/09/26	USD	500.000				89,508000	415.196,21	0,35
US87164KAC80	5,1820	SYNNVX 5.182 04/24/28	USD	200.000				101,069000	187.529,46	0,16
US87164KAG94	4,8920	SYNNVX 4.892 04/24/25	USD	200.000				100,947000	187.303,09	0,16
US87165BAM54	3,9500	SYF 3.95 12/01/27	USD	500.000				96,004000	445.328,88	0,37
US87264ABF12	3,8750	TMUS 3 7/8 04/15/30	USD	200.000				96,711000	179.443,36	0,15
US87264ACA16	2,0500	TMUS 2.05 02/15/28	USD	300.000				89,458000	248.978,57	0,21
US87264ACM53	3,4000	TMUS 3.4 10/15/52	USD	200.000				78,649000	145.930,05	0,12
US872898AA96	1,7500	TAISEM 1 3/4 10/25/26	USD	200.000		200.000		92,969000	172.500,23	0,14
US878091BE69	4,3750	TIAAGL 4 3/8 09/15/54	USD	1.000.000				99,483000	922.933,48	0,77
US88032WAN65	3,9750	TENCNT 3.975 04/11/29	USD	500.000				96,765000	448.858,89	0,38
US88032WBA36	2,8800	TENCNT 2.88 04/22/31	USD	300.000				88,117000	245.246,31	0,21
US883556BZ47	2,6000	TMO 2.6 10/01/29	USD	200.000				92,285000	171.231,10	0,14
US893574AH62	7,8500	WMB 7.85 02/01/26	USD	300.000				112,744000	313.787,92	0,26
US89400PAK93	2,4500	TCLAU 2.45 03/16/31	USD	100.000				84,789000	78.661,29	0,07
US898339AA49	4,8690	FUNOTR 4.869 01/15/30	USD	200.000				90,149000	167.267,84	0,14
US902494BH59	5,1000	TSN 5.1 09/28/48	USD	100.000				105,088000	97.493,27	0,08
US90265EAR18	3,0000	UDR 3 08/15/31	USD	100.000				89,731000	83.246,13	0,07
US90265EAS90	3,1000	UDR 3.1 11/01/34	USD	50.000				86,142000	39.958,25	0,03
US90265EAT73	2,1000	UDR 2.1 08/01/32	USD	100.000				81,546000	75.652,66	0,06
US90345WAA27	5,9000	AAL 5.9 10/01/24	USD	300.000				101,313000	119.912,39	0,10
US90351DAB38	4,1250	UBS 4 1/8 09/24/25	USD	200.000				100,965000	187.336,49	0,16
US90352JAC71	4,2530	UBS 4.253 03/23/28	USD	500.000				99,790000	462.890,81	0,39
US90352JAE38	2,8590	UBS 2.859 08/15/23	USD	300.000				100,218000	278.925,69	0,23
US907818FE31	3,9500	UNP 3.95 08/15/59	USD	100.000				91,340000	84.738,84	0,07
US90931CAA62	4,1500	UAL 4.15 08/25/31	USD	100.000				97,143000	71.767,39	0,06
US90931LAA61	3,1000	UAL 3.1 07/07/28	USD	300.000				94,463000	200.481,48	0,17
US90932JAA07	2,7000	UAL 2.7 05/01/32	USD	200.000				87,208000	147.256,20	0,12
US90932PAA66	4,0000	UAL 4 04/11/26	USD	200.000				96,396000	110.095,00	0,09
US91087BAN01	3,7710	MEX 3.771 05/24/61	USD	225.000				72,833000	152.031,03	0,13
US912810TB44	1,8750	T 1 7/8 11/15/51	USD	2.349.000	2.775.000	426.000		77,890625	1.697.421,64	1,42
US914906AS13	5,1250	UVN 5 1/8 02/15/25	USD	100.000				99,870000	92.652,38	0,08
US92343VCK89	4,8620	VZ 4.862 08/21/46	USD	100.000						

US92343VDR24	4,8120	VZ 4.812 03/15/39	USD	300.000		104,787000	291.642,08	0,24
US928563AE54	4,6500	VMW 4.65 05/15/27	USD	300.000		101,907000	283.626,50	0,24
US928563AF20	4,7000	VMW 4.7 05/15/30	USD	400.000		99,940000	370.869,28	0,31
US92857WBS89	4,8750	VOD 4 7/8 06/19/49	USD	200.000		97,511000	180.927,73	0,15
US92858RAA86	4,2500	VMED 4 1/4 01/31/31	USD	200.000		90,227000	167.412,56	0,14
US92936UAC36	4,0000	WPC 4 02/01/25	USD	200.000		100,826000	187.078,58	0,16
US92936UAE91	4,2500	WPC 4 1/4 10/01/26	USD	200.000		101,554000	188.429,35	0,16
US92940PAB04	4,6500	WRK 4.65 03/15/26	USD	400.000		102,914000	381.905,56	0,32
US949746RW34	3,0000	WFC 3 04/22/26	USD	100.000		97,377000	90.339,55	0,08
US94974BFP04	5,3750	WFC 5 3/8 11/02/43	USD	400.000		106,608000	395.613,69	0,33
US95000U2F97	3,1960	WFC 3.196 06/17/27	USD	500.000		97,248000	451.099,36	0,38
US960386AM29	4,9500	WAB 4.7 09/15/28	USD	300.000		101,096000	281.369,33	0,24
US960386AN02	4,4000	WAB 4.15 03/15/24	USD	200.000		101,255000	187.874,57	0,16
US96145DAH89	4,0000	WRK 4 03/15/28	USD	300.000		99,849000	277.898,69	0,23
US962166BR41	7,3750	WY 7 3/8 03/15/32	USD	113.000		121,913000	127.805,63	0,11
US962166BT07	6,8750	WY 6 7/8 12/15/33	USD	100.000	287.000	117,189000	108.719,73	0,09
US962166BX19	4,0000	WY 4 11/15/29	USD	400.000		98,594000	365.874,39	0,31
US980236AQ66	4,5000	WPLAU 4 1/2 03/04/29	USD	300.000		98,553000	274.291,68	0,23
US983130AX35	5,2500	WYNNLV 5 1/4 05/15/27	USD	150.000		92,197000	128.300,86	0,11
US98313RAD89	5,5000	WYNNMAC 5 1/2 10/01/27	USD	400.000		76,533000	284.007,79	0,24
US98313RAG11	5,5000	WYNNMAC 5 1/2 01/15/26	USD	200.000		80,500000	149.364,51	0,13
US984851AD75	3,8000	YARNO 3.8 06/06/26	USD	200.000		98,441000	182.653,31	0,15
US98978VAL71	3,0000	ZTS 3 09/12/27	USD	100.000		97,076000	90.060,30	0,08
USG82296AD99	3,5500	SMBCAC 3.55 04/15/24	USD	200.000		98,977000	183.647,83	0,15
XS1064799841	4,7500	MAFUAE 4 3/4 05/07/24	USD	400.000		100,903000	374.442,90	0,31
XS1794216660	4,7500	PNHAU 4 3/4 03/22/28	USD	500.000		97,707000	453.228,50	0,38
XS1938443329	4,0000	BOCAVI 4 01/25/24	USD	600.000		100,777000	560.962,98	0,47
XS2067255328	5,6250	BTSDF 5 5/8 10/24/24	USD	400.000		93,989000	348.785,60	0,29
XS2102867483	6,8000	FTLNHD 6.8 08/05/23	USD	300.000		66,402000	184.809,35	0,15
XS2122380822	8,2500	SUNSHI 8 1/4 11/25/23	USD	400.000		8,436000	31.305,32	0,03
XS2389983524	3,1250	SFHOLD 3 1/8 11/17/31	USD	200.000	200.000	86,749000	160.959,27	0,13
US67576JAB70	0,0000	ODEOLE 0 PERP	USD	30.712		0,689000	196,31	0,00

GELDMARKTPAPIERE

GELDMARKTPAPIERE US DOLLAR

US05971BAD10	5,5000	BTGPBZ 5 1/2 01/31/23	USD	200.000		101,473000	188.279,06	0,16
US29278NAL73	4,2500	ET 4 1/4 03/15/23	USD	400.000		100,691000	373.656,18	0,31
US31620RAF29	5,5000	FNF 5 1/2 09/01/22	USD	800.000		100,419000	745.293,63	0,62
US31847RAE27	4,3000	FAF 4.3 02/01/23	USD	150.000		100,799000	140.271,36	0,12
US34540XAB91	3,5500	F 3.55 10/07/22	USD	500.000		100,161000	464.611,75	0,39
US37045XDC74	1,9817	GM Float 11/17/23	USD	600.000	600.000	99,033000	551.255,22	0,46
US404280BW89	1,5809	HSBC Float 09/12/26	USD	700.000		100,354000	651.709,81	0,55
US606822AZ74	2,0737	MUFG Float 07/26/23	USD	100.000		100,476000	93.214,58	0,08
US654740BE85	1,6556	NSANY Float 09/28/22	USD	400.000		100,005000	371.110,49	0,31
US67576GAC15	6,7200	ODEBRE 6.72 12/01/22	USD	67.626		98,882000	8.750,85	0,01
US75625AAD63	4,5000	SLG 4 1/2 12/01/22	USD	500.000		100,652000	466.889,32	0,39
US84474YAB20	6,6500	LUV 6.65 08/01/22	USD	200.000		100,141000	5.985,02	0,01
US86562MBA71	1,9043	SUMIBK Float 07/19/23	USD	100.000		100,410000	93.153,35	0,08
US87164KAH77	4,4410	SYNNVX 4.441 04/24/23	USD	200.000		100,796000	187.022,91	0,16
US88165FAG72	2,9500	TEVA 2.95 12/18/22	USD	57.000		99,878000	52.816,09	0,04
USG42045AB32	4,7500	AVALCB 4 3/4 09/26/22	USD	200.000		100,146000	185.816,87	0,16
USP3772WAJ10	4,8750	BANBRA 4 7/8 04/19/23	USD	200.000		101,058000	187.509,05	0,16
US912796L640	0,0000	B 08/11/22	USD	3.000.000	3.000.000	99,798500	2.777.583,83	2,33

SUMME DER ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT ZUGELASSENEN WERTPAPIERE **101.776.639,17** **85,32**

ANLEIHEN

ANLEIHEN US DOLLAR

US76110WX275	1,7057	RASC 2005-KS5 M6	USD	600.000		100,036518	327.820,54	0,27	
US912803FG36	0,0000	SP 0 02/15/49	USD	2.500.000		500.000	44.732301	1.037.487,27	0,87
US912803FL21	0,0000	SP 0 11/15/49	USD	600.000		3.000.000	44,010426	244.978,71	0,21
US912803GC13	0,0000	SP 0 11/15/51	USD	1.100.000	1.100.000		41,897571	427.565,90	0,36

SUMME DER NICHT ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT ZUGELASSENEN WERTPAPIERE **2.037.852,42** **1,71**

SUMME WERTPAPIERVERMÖGEN

117.817.313,76 **98,76**

BANKGUTHABEN

EUR-Verbindlichkeiten							-104.031,39	-0,09
GUTHABEN/VERBINDLICHKEITEN IN NICHT-EU-WÄHRUNGEN								
USD							527.921,74	0,44

SUMME BANKGUTHABEN **423.890,35** **0,36**

ABGRENZUNGEN

ZINSENANSPRÜCHE							1.053.782,76	0,88
-----------------	--	--	--	--	--	--	--------------	------

SUMME ABGRENZUNGEN **1.053.782,76** **0,88**

SUMME Fondsvermögen

119.294.986,87 **100,00**

ERRECHNETER WERT 10014T01 Allianz PIMCO Corporate (A)						EUR	44,34	
ERRECHNETER WERT 10014T02 Allianz PIMCO Corporate (T)						EUR	80,75	
UMLAUFENDE ANTEILE 10014T01 Allianz PIMCO Corporate (A)						STUECK	2.599.252,95	
UMLAUFENDE ANTEILE 10014T02 Allianz PIMCO Corporate (T)						STUECK	50.726,358	

UMRECHNUNGSKURSE/DEISENKURSE

VERMÖGENSWERTE IN FREMDER WÄHRUNG ZU DEN DEISENUMRECHNUNGSKURSEN
DER LETZTEN PREISBERECHNUNG VOR DEM STICHTAG:

WÄHRUNG		EINHEIT in EUR	KURS
Euro	EUR	1 = EUR	1,000000
US Dollar	USD	1 = EUR	1,077900

WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMES GETÄTIGTE KÄUFE UND VERKÄUFE IN WERTPAPIEREN SOWEIT SIE NICHT IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG GENANNT SIND

ISIN	Zinssatz	Wertpapier	Währung	Bestand	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
ANLEIHEN US DOLLAR						
US00203QAB32	3,7500	MAERSK 3 3/4 09/22/24	USD	0		200.000
US00206RKF81	3,5000	T 3 1/2 02/01/61	USD	0		4.200.000
US05947KAZ30	3,2000	BRADES 3.2 01/27/25	USD	0		300.000
US06738EAE59	3,6500	BACR 3.65 03/16/25	USD	0		325.000
US06738EBF16	1,5860	BACR Float 02/15/23	USD	0		200.000
US10112RBD52	3,2500	BXP 3 1/4 01/30/31	USD	0		100.000
US101137AR84	3,8500	BSX 3.85 05/15/25	USD	0		153.000
US101137AW79	3,7500	BSX 3 3/4 03/01/26	USD	0		200.000
US1248EPCK74	4,2500	CHTR 4 1/4 02/01/31	USD	0		200.000
US12543DBF69	6,6250	CYH 6 5/8 02/15/25	USD	0		100.000
US126307BA42	5,7500	CSCDLD 5 3/4 01/15/30	USD	0		300.000
US12770RAA14	5,7500	CGPHLC 5 3/4 07/01/25	USD	0		50.000
US23283PAR55	3,4500	CONE 3.45 11/15/29	USD	0		200.000
US25179MAX11	5,2500	DVN 5 1/4 09/15/24	USD	0		32.000
US257559AK07	6,7500	UFS 6 3/4 02/15/44	USD	0		200.000
US26885BAA89	4,0000	EQM 4 08/01/24	USD	0		300.000
US28470RAH57	6,2500	CZR 6 1/4 07/01/25	USD	0		250.000
US345397ZM88	5,5960	F 5.596 01/07/22	USD	0		500.000
US35640YAA55	8,1250	FREMOR 8 1/8 11/15/24	USD	0		100.000
US35640YAB39	8,2500	FREMOR 8 1/4 04/15/25	USD	0		80.000
US39530MAA62	4,3000	GRNKEN 4.3 12/13/28	USD	0	200.000	
US44701QBE17	4,5000	HUN 4 1/2 05/01/29	USD	0		200.000
US46556JAB52	3,2500	ITAU 3 1/4 01/24/25	USD	0		300.000
US527298BQ51	3,8750	LVL 3 7/8 11/15/29	USD	0		300.000
US538034AV10	6,5000	LYV 6 1/2 05/15/27	USD	0		200.000
US55300RAB78	5,8750	MGMCHI 5 7/8 05/15/26	USD	0		200.000
US55303XAF24	4,5000	MGMGPO 4 1/2 01/15/28	USD	0		200.000
US55303XAJ46	5,7500	MGMGPO 5 3/4 02/01/27	USD	0		100.000
US63861VAD91	3,6220	NWIDE 3.622 04/26/23	USD	0		200.000
US651290AR99	5,3750	OVV 5 3/8 01/01/26	USD	0		100.000
US674599DB86	6,9500	OXY 6.95 07/01/24	USD	0		100.000
US674599DC69	5,5500	OXY 5.55 03/15/26	USD	0		300.000
US68622TAA97	4,1250	OGN 4 1/8 04/30/28	USD	0		200.000
US71654QBW15	4,5000	PEMEX 4 1/2 01/23/26	USD	0		100.000
US71654QCG55	6,5000	PEMEX 6 1/2 03/13/27	USD	0		800.000
US780097BE04	3,4980	NWG 3.498 05/15/23	USD	0		700.000
US780153AZ50	11,5000	RCL 11 1/2 06/01/25	USD	0		120.000
US78081BAH69	1,2000	RPRX 1.2 09/02/25	USD	0		200.000
US82939GAB41	4,1250	SINOPE 4 1/8 09/12/25	USD	0		400.000
US853496AD99	4,7500	BMCAUS 4 3/4 01/15/28	USD	0		100.000
US90931GAA76	5,8750	JAL 5 7/8 10/15/27	USD	0		169.368
US912810SW99	1,8750	T 1 7/8 02/15/41	USD	0		600.000
US912810SX72	2,3750	T 2 3/8 05/15/51	USD	0		34.000
US912810SZ21	2,0000	T 2 08/15/51	USD	0		3.300.000
US91282CEN74	2,7500	T 2 3/4 04/30/27	USD	0	2.800.000	2.800.000
US91911TAP84	6,2500	VALEBZ 6 1/4 08/10/26	USD	0		400.000
US962166AT16	8,5000	WY 8 1/2 01/15/25	USD	0		200.000
US98956PAF99	3,5500	ZBH 3.55 04/01/25	USD	0		300.000
USP16259AK29	4,3750	BBVASM 4 3/8 04/10/24	USD	0		200.000
USP8000UAA71	6,7000	PEMEX 6.7 02/16/32	USD	0	594.000	594.000
USP8000UAB54	6,7000	PEMEX 6.7 02/16/32	USD	0	594.250	594.000
XS1958532829	4,2000	VNKRL 4.2 06/07/24	USD	0		200.000
XS2078642183	3,5000	VNKRL 3 1/2 11/12/29	USD	0		300.000
XS2099049699	2,8750	SFHOLD 2 7/8 02/20/30	USD	0		200.000
XS2211037184	2,6250	CONAMP 2 5/8 09/17/30	USD	0		200.000
US912796A908		B 12/30/21	USD	0	300.000	300.000
US912796K576		B 07/14/22	USD	0	900.000	900.000
US912796L988		B 03/03/22	USD	0	900.000	900.000
US912796N885		B 11/30/21	USD	0		500.000
US912796P294		B 04/14/22	USD	0	900.000	1.400.000
US912796Q367		B 05/26/22	USD	0	1.100.000	1.100.000
US912796Q854		B 01/25/22	USD	0	500.000	500.000
US912796Q938		B 02/01/22	USD	0	1.000.000	1.000.000
US912796R688		B 07/07/22	USD	0	500.000	500.000
US912796R761		B 02/08/22	USD	0	1.300.000	1.300.000
US912796S751		B 03/08/22	USD	0	2.200.000	2.200.000
US912796S918		B 03/22/22	USD	0		700.000
US912796T254		B 03/29/22	USD	0		500.000
US912796V979		B 06/14/22	USD	0	500.000	500.000
US912796W217		B 06/21/22	USD	0	700.000	700.000
US912796W399		B 06/28/22	USD	0	600.000	600.000
ANLEIHEN US DOLLAR						
US912796V227		CMB 05/24/22	USD	0	500.000	500.000
US912796Y940		CMB 12/31/21	USD	0	700.000	700.000