

ISIN	DESCRIPTION	TIME	QUANTITY	PRICE	CURRENCY
XS0215093534	FINMECCANICA 4.875% 24.03.2025	15:43:05	250000	97.55	EUR
IT0003934657	BTP 4% 01.02.37	15:43:06	99000	91.4	EUR
US2546871060	Walt Disney	15:43:10	100	48.46	EUR
IT0004546955	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 30.11.2015	15:43:44	36000	99.9	EUR
XS0379218315	Mediobanca TV Cap&Floor 30.09.2014	15:43:44	10000	102.6	EUR
XS0173287516	MPS 4.375% 30.07.2013	15:44:04	40000	100.06	EUR
XS0173287516	MPS 4.375% 30.07.2013	15:44:04	10000	100.05	EUR
IT0004505076	BTP 3.5% 01.06.2014	15:44:05	15000	102.32	EUR
IT0004518582	UNICREDIT TV FLOOR 08.09.2015	15:44:06	10000	100.86	EUR
IT0004518582	UNICREDIT TV FLOOR 08.09.2015	15:44:06	5000	100.85	EUR
IT0003934657	BTP 4% 01.02.37	15:44:21	99000	91.4	EUR
XS0338813636	Mediobanca Euribor Spread Variabile 31.01.2014	15:44:21	25000	98.94	EUR
XS0379218315	Mediobanca TV Cap&Floor 30.09.2014	15:44:43	5000	102.6	EUR
IT0004596414	BNL FIXED FLOATER CAP & FLOOR 30.04.2015	15:44:52	15000	100.18	EUR
IT0004785298	INTESA SANPAOLO 5.8% 06.02.2014	15:45:02	5000	102.89	EUR
IT0004811649	MPS 3.75% AMORTISING 02.05.2017	15:45:07	815	96.63	EUR
IT0004465487	INTESA SANPAOLO EUR TV FLOOR 31.03.2015	15:45:13	10000	102.27	EUR
IT0004809932	UNICREDIT FIXED FLOATER 30.04.2016	15:45:18	15000	99.63	EUR
IT0004801939	VENETO BANCA FIXED FLOATER CAP & FLOOR 02.04.2017	15:45:26	2000	101.7	EUR
IT0004615917	BTP 3% 15.06.2015	15:45:29	12000	102.14	EUR
IT0004659758	CENTROBANCA - TV CAP & FLOOR 30.12.2016	15:45:32	1000	97.66	EUR
XS0878118594	BEI 5% 29.04.2016	15:45:34	50000	96.94	ZAR
NZIBDDT006C8	INTERNAT BANK RECONSTRUC DEVELOP 3.625% 20.02.2018	15:45:47	25000	100.42	NZD
XS0555834984	BANCO POPOLARE 6% SUBORDINATO 05.11.2020	15:45:48	50000	101.1	EUR
IT0004572167	CENTROBANCA TV CAP & FLOOR 05.03.2016	15:45:55	23000	97.32	EUR
IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	15:45:57	200000	100.74	EUR
NL0010122255	BNP ISS ICE BRENT CRUDE OIL AUTOCALL 07.05.2015	15:46:04	100	101.08	EUR
XS0367497681	Banca Imi TV Floor 30.06.2014	15:46:10	1000	102.12	EUR
XS0182242247	Finmeccanica Finance 5,75% 12.12.2018	15:46:36	3000	107.34	EUR
XS0182242247	Finmeccanica Finance 5,75% 12.12.2018	15:46:36	7000	107.34	EUR
XS0389817064	Banca Imi TV Floor 18.11.2014	15:46:50	10000	102.54	EUR
IT0004802275	BNL TV 30.03.2015	15:46:56	5000	99.65	EUR
IT0004917958	BTP ITALIA 2.25% 22.04.2017	15:46:58	20000	100.55	EUR
IT0004806730	UNICREDIT STEP UP 20.04.2018	15:47:08	50000	102.9	EUR
IT0004400658	Intesa Sanpaolo 4% Amortising Sub 30.09.2015	15:47:33	3000	100.88	EUR
IT0004669575	UNICREDIT - TV CAP & FLOOR 31.01.2017	15:47:33	12000	99.03	EUR
IT0004669575	UNICREDIT - TV CAP & FLOOR 31.01.2017	15:47:33	10000	99.04	EUR
IT0004669575	UNICREDIT - TV CAP & FLOOR 31.01.2017	15:47:33	3000	99.04	EUR
IT0004776230	UNICREDIT TV 19.12.2017	15:47:39	18000	96.68	EUR
IT0004820251	CTZ ZC 30.05.2014	15:47:48	7000	99.066	EUR
US922646AS37	Venezuela 9,25% 15.09.27	15:47:52	3000	88.87	USD
IT0004656275	BTP 3% 01.11.2015	15:47:52	10000	102.11	EUR
XS0465889912	FIAT FINANCE & TRADE 6.875% 13.02.2015	15:48:00	50000	105.71	EUR
IT0003934657	BTP 4% 01.02.37	15:48:06	76000	91.4	EUR
XS0210918123	MPS 3,875% 02.02.15	15:48:13	10000	100.05	EUR
IT0004546955	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 30.11.2015	15:48:15	1000	99.94	EUR

IT0004594930	BTP 4% 01.09.2020	15:48:16	40000	102.23	EUR
DE0001030542	REPUBBLICA TEDESCA BUNDÇi 0,1% 15.04.2023	15:48:20	2000	102.05	EUR
IT0003934657	BTP 4% 01.02.37	15:48:23	30000	91.44	EUR
XS0222841933	BANCA POP DI MILANO TV CALL SUB 29.06.2015	15:48:28	12000	95.09	EUR
XS0222841933	BANCA POP DI MILANO TV CALL SUB 29.06.2015	15:48:28	8000	95.1	EUR
XS0210918123	MPS 3,875% 02.02.15	15:48:30	15000	100.14	EUR
XS0210918123	MPS 3,875% 02.02.15	15:48:30	5000	100.15	EUR
IT0004917958	BTP ITALIA 2.25% 22.04.2017	15:48:33	25000	100.55	EUR
XS0461107905	BANCA IMI STEP UP FLOATER CAP 22.12.2015	15:48:37	40000	94.79	EUR
IT0004917958	BTP ITALIA 2.25% 22.04.2017	15:48:44	20000	100.55	EUR
IT0004164775	BTP 4% 01.02.17	15:48:55	10000	104.459	EUR
XS0521710599	IMI EQUITY PROTECTION WORLD INDICES 21.07.2016	15:48:55	8	1168.95	EUR
IT0004874654	MEDIOBANCA FIXED FLOATER 31.01.2018	15:48:58	2000	97.99	EUR
IT0004883689	UNICREDIT SPA STEP UP AMRT SUB 28.02.2020	15:49:05	12000	101.31	EUR
XS0787655421	BANCA IMI ZC 04.07.2015	15:49:15	20000	95.37	EUR
XS0787655421	BANCA IMI ZC 04.07.2015	15:49:15	10000	95.35	EUR
IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	15:49:26	200000	100.74	EUR
IT0004361041	BTP 4,5% 01.08.2018	15:49:29	120000	106.08	EUR
IT0004808496	VENETO BANCA 4% 02.05.2015	15:49:29	5000	102.54	EUR
IT0004574023	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 26.02.2016	15:49:36	5000	98.63	EUR
XS0487392291	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA TV FLOOR 10.03.2016	15:49:39	5000	101.31	EUR
XS0630289246	BANCA IMI EQUITY PROTECTION S&P 500 30.06.2017	15:49:57	5	1131.35	EUR
IT0006636770	Morgan Stanley CMS Floor - FTSE MIB 29.06.2013	15:50:07	1000	99.97	EUR
XS0367497681	Banca Imi TV Floor 30.06.2014	15:50:10	4000	102.12	EUR
IT0004632862	CENTROBANCA STEP UP 30.09.2016	15:50:12	15000	99.34	EUR
US0378331005	Apple	15:50:32	5	322.75	EUR
XS0210918123	MPS 3,875% 02.02.15	15:50:33	20000	100.15	EUR
IT0004898034	BTP 4.5% 01.05.2023	15:50:35	40000	102.3	EUR
IT0003269385	BANCA POPOLARE DI VICENZA ZC 16.01.2017	15:50:54	12000	86.46	EUR
IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	15:50:58	100000	100.74	EUR
IT0004632862	CENTROBANCA STEP UP 30.09.2016	15:51:14	25000	99.33	EUR
IT0003644769	BTP 4,50% 01.02.20	15:51:15	28000	105.15	EUR
IT0004851421	BANCA POPOLARE DI VICENZA 3% 28.10.2014	15:51:16	10000	100.28	EUR
IT0004465487	INTESA SANPAOLO EUR TV FLOOR 31.03.2015	15:51:20	45000	102.27	EUR
IT0004465487	INTESA SANPAOLO EUR TV FLOOR 31.03.2015	15:51:20	5000	102.22	EUR
XS0229567440	GENERAL ELECTRIC CAPITAL 4.125% SUBORD 19.09.2035	15:51:23	22000	102.6	EUR
XS0229567440	GENERAL ELECTRIC CAPITAL 4.125% SUBORD 19.09.2035	15:51:23	24000	102.58	EUR
IT0004898034	BTP 4.5% 01.05.2023	15:51:27	10000	102.31	EUR
IT0004273493	BTP 4,5% 01.02.2018	15:51:31	6000	106.16	EUR
IT0004551419	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 18.12.2015	15:51:33	17000	99.47	EUR
XS0202649934	Repsol Int. Finance 4,625% 08.10.2014	15:51:37	1000	104.7	EUR
XS0460430142	BANCA IMI FIXED FLOATER CAP&FLOOR 18.12.2016	15:51:38	8000	98.31	EUR
XS0460430142	BANCA IMI FIXED FLOATER CAP&FLOOR 18.12.2016	15:51:38	12000	98.3	EUR
IT0004361041	BTP 4,5% 01.08.2018	15:51:59	28000	106.08	EUR
XS0882849507	GOLDMAN SACHS GROUP 3.25% 01.02.2023	15:52:00	1000	101.76	EUR
XS0352674682	KBC Ifima Flexible Fixed Rate 16.05.2014	15:52:01	7000	102.06	EUR
IT0004590979	BANCA POPOLARE DI VICENZA 3% 31.03.2015	15:52:17	15000	100.16	EUR

IT0004653108	BTP 2,25% 01.11.2013	15:52:18	20000	100.62	EUR
EU000A1G0A24	EFSF 1.125% 30.11.2017	15:52:20	5000	100.62	EUR
IT0004512544	UNICREDIT FIXED FLOATER 31.07.2015	15:52:22	10000	96.68	EUR
IT0004532187	BANCA IMI TV CAP & FLOOR 30.10.2016	15:52:22	7000	98.9	EUR
IT0004532187	BANCA IMI TV CAP & FLOOR 30.10.2016	15:52:22	3000	98.92	EUR
XS0858481194	BEI 5.5% 28.11.2017	15:52:25	4000	96.6	TRY
IT0004632862	CENTROBANCA STEP UP 30.09.2016	15:52:26	15000	99.34	EUR
IT0004632862	CENTROBANCA STEP UP 30.09.2016	15:52:26	15000	99.34	EUR
IT0004625890	BANCA IMI TV FLOOR 06.09.2013	15:52:27	1000	100.28	EUR
IT0004587496	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 31.03.2016	15:52:35	10000	98.04	EUR
IT0004803182	BANCA POPOLARE DI VICENZA 5% 15.03.2018	15:52:37	3000	101.81	EUR
IT0004761950	BTP 4,75% 15.09.2016	15:52:37	5000	106.71	EUR
XS0551319964	NORDEA BANK STEP UP 30.11.2016	15:52:41	1000	103.55	EUR
IT0004557218	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 15.01.2016	15:52:42	4000	98.87	EUR
IT0004557218	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 15.01.2016	15:52:42	6000	98.87	EUR
IT0004762586	UNICREDIT FIXED FLOATER 30.09.2017	15:53:10	12000	99.89	EUR
IT0004762586	UNICREDIT FIXED FLOATER 30.09.2017	15:53:10	50000	99.92	EUR
IT0004762586	UNICREDIT FIXED FLOATER 30.09.2017	15:53:10	12000	99.93	EUR
XS0702208066	BANCA IMI 5 AZIONI EUROPA AUTOCALLABLE 28.12.2017	15:53:10	5000	97.54	EUR
IT0003618383	BTP 4,25% 01.08.14	15:53:10	4000	103.355	EUR
XS0551319964	NORDEA BANK STEP UP 30.11.2016	15:53:10	1000	103.55	EUR
XS0300900478	EXOR 5.375% 12.06.2017	15:53:10	50000	109.25	EUR
DE000A1PGWA5	DAIMLER 2.375% 12.09.2022	15:53:10	2000	101.96	EUR
IT0004816655	BANCA POPOLARE DI VICENZA 3% 18.05.2015	15:53:10	15000	100.14	EUR
IT0004776230	UNICREDIT TV 19.12.2017	15:53:10	5000	96.68	EUR
IT0004682529	INTESA SANPAOLO - TV CAP & FLOOR 03.03.2015	15:53:11	25000	102.46	EUR
IT0004762586	UNICREDIT FIXED FLOATER 30.09.2017	15:53:11	10000	99.88	EUR
XS0201271045	Intesa Sanpaolo TV 01.10.2014	15:53:11	17000	98.97	EUR
FR0011233451	PEUGEOT 5.625% 11.07.2017	15:53:11	5000	101.99	EUR
XS0236480322	MPS TV Callable Subordinato 30.11.2017	15:53:11	50000	77.99	EUR
XS0767839185	BEI TV 15.01.2019	15:53:11	4000	101.56	EUR
XS0219724878	BEI 4% 15.10.37	15:53:11	51000	123.25	EUR
IT0004842727	BANCA IMI 3.7% 12.09.2014	15:53:11	3000	102.48	EUR
XS0749901855	BANCA IMI EP SECTOR INDICES BSKT 04.04.2016	15:53:11	10	1011.5	EUR
IT0001250122	Intesa Sanpaolo TV 01.09.2013	15:53:11	6000	99.77	EUR
IT0004698426	UNICREDIT SPA STEP UP AMRT SUB 31.03.2018	15:53:11	10000	101.75	EUR
PTOTEMOE0027	REPUBBLICA PORTOGHESE -OT 4.75% 14.06.2019	15:53:11	3000	95.66	EUR
IT0004019581	BTP 3,75% 01.08.16	15:53:11	1000	103.828	EUR
IT0004695075	BTP 4,75% 01.09.2021	15:53:11	100000	106.33	EUR
US465410BV92	Republic of Italy 3,125% 26.01.2015	15:53:11	100000	103.1	USD
IT0004762578	UNICREDIT TV 31.10.2017	15:53:26	4000	96.54	EUR
IT0004630379	BANCA POPOLARE DI VICENZA FIXED FLOATER 30.07.2015	15:53:32	10000	94.41	EUR
IT0004806888	BTP ITALIA 2,45% 26.03.2016	15:53:52	6000	102.23	EUR
XS0878091882	BANCA POPOLARE DI MILANO 4% 22.01.2016	15:53:58	100000	100.71	EUR
XS0196448129	BEI 4,625% 15.04.20	15:54:07	1000	121.16	EUR
IT0004791460	INTESA SANPAOLO 4.3% 06.02.2014	15:54:21	1000	101.95	EUR
XS0377362958	Hsbc Bank TV 29.08.2014	15:54:23	20000	99.36	EUR

US912810FE39	T-BOND 5,5% 15.08.2028	15:54:45	15000	134.56	USD
IT0001309423	Intesa Sanpaolo CMS Subordinato 09.03.2014	15:54:45	5000	99.15	EUR
IT0004917792	BTP 2.25% 15.05.2016	15:54:46	8000	99.73	EUR
XS0318345971	BEI ZC 05.09.2022	15:54:50	1000	53.2	TRY
IT0004638679	BANCA POPOLARE DI VICENZA FIXED FLOATER 29.09.2015	15:54:51	5000	93.56	EUR
IT0004505076	BTP 3.5% 01.06.2014	15:55:04	15000	102.316	EUR
IT0004546955	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 30.11.2015	15:55:05	11000	99.94	EUR
IT0004546955	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 30.11.2015	15:55:05	14000	99.94	EUR
IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	15:55:07	200000	100.74	EUR
IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	15:55:07	50000	100.74	EUR
XS0367777884	UNICREDIT 6.7% SUBORDINATO 05.06.2018	15:55:09	50000	105.01	EUR
IT0004750250	INTESA SANPAOLO 5% 12.09.2015	15:55:14	10000	105.5	EUR
IT0004917958	BTP ITALIA 2.25% 22.04.2017	15:55:14	1000	100.55	EUR
IT0004799927	UNICREDIT 4% 30.01.2016	15:55:14	17000	102.36	EUR
IT0004917792	BTP 2.25% 15.05.2016	15:55:14	22000	99.73	EUR
IT0004762586	UNICREDIT FIXED FLOATER 30.09.2017	15:55:14	8000	99.93	EUR
IT0004620305	CCT EU FRN 15.12.2015	15:55:14	10000	98.12	EUR
XS0875034703	RABOBANK NEDERLAND 4.25% 22.01.2018	15:55:14	26000	101.32	AUD
IT0004898034	BTP 4.5% 01.05.2023	15:55:14	5000	102.31	EUR
IT0004423114	Intesa Sanpaolo Amortising 6,25% Sub 12.11.2015	15:55:14	10200	103.28	EUR
US36962G2F08	GENERAL ELECTRIC CAPITAL TV 15.02.2017	15:55:14	8000	99.5	USD
XS0460430142	BANCA IMI FIXED FLOATER CAP&FLOOR 18.12.2016	15:55:14	8000	98.3	EUR
XS0342638094	Goldman Sachs 3,95% 28.02.2014	15:55:14	3000	102.27	EUR
IT0004889033	BTP 4.75% 01.09.2028	15:55:14	12000	102.01	EUR
IT0004656275	BTP 3% 01.11.2015	15:55:14	28000	102.11	EUR
XS0371420182	Banca Imi TV Floor 31.07.2014	15:55:18	1000	102.33	EUR
IT0004907843	BTP 3.5% 01.06.2018	15:55:31	10000	101.47	EUR
IT0004761950	BTP 4,75% 15.09.2016	15:55:38	100000	106.68	EUR
US36962GK948	GE Capital Corporation TV 15.09.2014	15:55:40	25000	100.19	USD
IT0004776230	UNICREDIT TV 19.12.2017	15:55:47	40000	96.64	EUR
IT0004302946	Dexia Crediop TV 18.01.2014	15:55:51	20000	98.23	EUR
IT0004302946	Dexia Crediop TV 18.01.2014	15:55:51	15000	98.22	EUR
XS0906046270	GE CAPITAL AUSTRALIA FUNDING 4.25% 20.03.2017	15:55:56	6000	101.5	AUD
IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	15:56:00	250000	100.74	EUR
IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	15:56:00	250000	100.74	EUR
IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	15:56:00	50000	100.74	EUR
IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	15:56:00	200000	100.74	EUR
IT0004680804	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 28.02.2017	15:56:06	11000	100.56	EUR
IT0003934657	BTP 4% 01.02.37	15:56:12	20000	91.43	EUR
IT0003934657	BTP 4% 01.02.37	15:56:12	70000	91.4	EUR
IT0004536949	BTP 4,25% 01.03.2020	15:56:16	164000	103.72	EUR
IT0003934657	BTP 4% 01.02.37	15:56:17	6000	91.4	EUR
IT0003934657	BTP 4% 01.02.37	15:56:17	18000	91.4	EUR
XS0501195480	REPUBBLICA ARGENTINA 8.75% 02.06.2017	15:56:23	460	77.6	USD
IT0004354707	Unicredit Step Up 05.05.2014	15:56:30	9000	103.32	EUR
IT0004634132	BTP 3,75% 01.03.2021	15:56:30	30000	100.62	EUR
XS0446693409	BNP PARIBAS 2.75% 30.09.2013	15:56:32	15000	100.59	EUR

XS0426505102	MPS 4,75% 30.04.2014	15:56:42	50000	100.42	EUR
IT0003934657	BTP 4% 01.02.37	15:56:42	2000	91.4	EUR
IT0003934657	BTP 4% 01.02.37	15:56:42	47000	91.4	EUR
DE0001135309	BUND 4% 04.07.16	15:56:44	43000	111.423	EUR
XS0210629522	Telekom Finanzmanagement 4,25% 27.01.2017	15:56:46	1000	110.39	EUR
XS0340282739	KBC Ifima TV Floor 31.03.2014	15:56:48	53000	102.35	EUR
IT0004806888	BTP ITALIA 2,45% 26.03.2016	15:56:51	39000	102.23	EUR
IT0004806888	BTP ITALIA 2,45% 26.03.2016	15:56:51	45000	102.23	EUR
IT0004806888	BTP ITALIA 2,45% 26.03.2016	15:56:51	16000	102.23	EUR
FR0010216481	OAT 3% 25.10.15	15:57:05	48000	106.16	EUR
IT0004576978	ENEL 3.5% 26.02.2016	15:57:06	2000	103.64	EUR
IT0004634132	BTP 3,75% 01.03.2021	15:57:35	100000	100.6	EUR
AT0000386198	Repubblica Austriaca 3,5% 15.07.2015	15:57:35	16000	106.76	EUR
IT0004633985	INTESA SANPAOLO TV CAP & FLOOR 04.10.2014	15:57:37	1000	100.71	EUR
IT0004866551	BANCO POPOLARE TV CAP & FLOOR 06.12.2017	15:57:37	20000	101.45	EUR
XS0250338844	ING GROEP TV 11.04.2016	15:57:38	2000	99	EUR
IT0004848831	BTP 5.5% 01.11.2022	15:57:44	200000	110.11	EUR
BE0000303124	Belgium Kingdom 4,25% 28.09.14	15:57:51	11000	105.2	EUR
XS0794230507	GE CAPITAL EUROPEAN FUNDING 2.875% 18.06.2019	15:57:53	1000	106.53	EUR
XS0529330218	BANCA IMI FIXED TO EUR USD 30.09.2016	15:57:54	30000	95.23	EUR
IT0004801541	BTP 5,5% 01.09.2022	15:57:57	200000	110.19	EUR
XS0500187843	INTESA SANPAOLO 4.125% 14.04.2020	15:58:05	50000	101.97	EUR
XS0500187843	INTESA SANPAOLO 4.125% 14.04.2020	15:58:05	50000	101.97	EUR
BE0000306150	Regno del Belgio 3,75% 28.09.2015	15:58:08	7000	107.74	EUR
IT0004682529	INTESA SANPAOLO - TV CAP & FLOOR 03.03.2015	15:58:10	18000	102.46	EUR
IT0004889033	BTP 4.75% 01.09.2028	15:58:19	10000	102.1	EUR
IT0004594930	BTP 4% 01.09.2020	15:58:20	200000	102.2	EUR
XS0500187843	INTESA SANPAOLO 4.125% 14.04.2020	15:58:24	50000	101.98	EUR
ES00000122R7	REGNO DI SPAGNA BONOS 2.5% 31.10.2013	15:58:24	18000	100.75	EUR
EU000A1G0AU4	EFSS 1.625% 15.09.2017	15:58:24	1000	103.08	EUR
XS0210629522	Telekom Finanzmanagement 4,25% 27.01.2017	15:58:24	1000	110.39	EUR
XS0426505102	MPS 4,75% 30.04.2014	15:58:24	50000	100.44	EUR
US465410BN76	Italy 4,5% 21.01.15	15:58:48	8000	105.18	USD
ES00000123D5	REGNO DI SPAGNA BONOS 3.4% 30.04.2014	15:58:50	21000	101.81	EUR
US298785FL50	BEI 1.25% 14.02.2014	15:58:59	5000	100.7	USD
ES00000123P9	REGNO DI SPAGNA BONOS 3.75% 31.10.2015	15:59:01	31000	102.7	EUR
IT0003934657	BTP 4% 01.02.37	15:59:03	29000	91.4	EUR
IT0003934657	BTP 4% 01.02.37	15:59:03	50000	91.4	EUR
IT0004761950	BTP 4,75% 15.09.2016	15:59:05	150000	106.68	EUR
IT0004503766	ENI TV 29.06.2015	15:59:05	2000	100.81	EUR
FR0116114978	BTAN 2,50% 12.01.2014	15:59:16	21000	101.385	EUR
US36962GK948	GE Capital Corporation TV 15.09.2014	15:59:25	1000	100.18	USD
XS0215093534	FINMECCANICA 4.875% 24.03.2025	15:59:25	50000	97.7	EUR
FR0119105809	BTAN 2,25% 25.02.2016	15:59:32	42000	104.84	EUR
IT0004716319	CCT EU FRN 15.04.2018	15:59:37	7000	94.56	EUR
XS0342289575	BARCLAYS BANK 6% SUBORDINATO 23.01.2018	15:59:37	100000	112.07	EUR
XS0336285100	Mediobanca TV Floor 15.02.2014	15:59:38	12000	101.22	EUR

XS0298329516	MPS TV 09.05.2014	15:59:39	50000	97.05	EUR
IT0004615305	UNICREDIT STEP UP AMORTISING SUB 14.06.2017 EUR	15:59:39	12800	101.32	EUR
IT0004615305	UNICREDIT STEP UP AMORTISING SUB 14.06.2017 EUR	15:59:39	23200	101.31	EUR
IT0004822240	UNICREDIT 4.4% 03.07.2015	15:59:39	5000	103.35	EUR
XS0340282739	KBC Ifima TV Floor 31.03.2014	15:59:39	50000	102.24	EUR
XS0166965797	MUNICH RE FIN FIXED FLOATER CALL SUBORD 21.06.2023	15:59:39	13000	100.01	EUR
IT0003618383	BTP 4,25% 01.08.14	15:59:55	180000	103.355	EUR
IT0004887896	INTESA SANPAOLO STEP UP 08.02.2019	15:59:55	4000	98.6	EUR
IT0004776230	UNICREDIT TV 19.12.2017	15:59:55	22000	96.68	EUR
XS0455699263	Rabobank TV 30.10.2015	15:59:57	30000	99.28	EUR
DE000HV77964	UNICREDITBANK BONUS FTSE MIB 12.07.2013	15:59:57	50	109	EUR
DE000HV77964	UNICREDITBANK BONUS FTSE MIB 12.07.2013	15:59:57	100	109	EUR
IT0004505076	BTP 3.5% 01.06.2014	15:59:57	50000	102.316	EUR
US17275R1023	Cisco	16:00:03	200	18.57	EUR
XS0201271045	Intesa Sanpaolo TV 01.10.2014	16:00:11	2000	98.98	EUR
IT0004698418	UNICREDIT FIXED FLOATER AMORTISING SUB 31.03.2018	16:00:20	17000	93.2	EUR
XS0298329516	MPS TV 09.05.2014	16:00:25	50000	97.05	EUR
IT0004716319	CCT EU FRN 15.04.2018	16:00:31	5000	94.52	EUR
XS0631820957	BANCA IMI CINQUE AZIONI 30.06.2017	16:00:32	21000	90.14	EUR
IT0004643596	INTESA SANPAOLO TV CAP & FLOOR 04.11.2017	16:00:33	10000	99.9	EUR
IT0004607302	UNICREDIT - TV CAP & FLOOR 31.05.2016 EUR	16:00:46	5000	93.06	EUR
IT0004532187	BANCA IMI TV CAP & FLOOR 30.10.2016	16:00:55	3000	98.78	EUR
IT0004532187	BANCA IMI TV CAP & FLOOR 30.10.2016	16:00:55	30000	98.76	EUR
IT0004532187	BANCA IMI TV CAP & FLOOR 30.10.2016	16:00:55	2000	98.75	EUR
US298785FZ47	BEI 1% 15.12.2017	16:00:56	50000	99.12	USD
IT0004655483	CENTROBANCA FIXED FLOATER 20.12.2015	16:01:01	50000	94.75	EUR
IT0004756216	INTESA SANPAOLO 4.2% 13.09.2013	16:01:05	8000	100.74	EUR
XS0379218315	Mediobanca TV Cap&Floor 30.09.2014	16:01:09	10000	102.6	EUR
IT0003844534	BTP 3,75% 01.08.15	16:01:09	250000	103.55	EUR
IT0006643040	Morgan Stanley FTSE MIB 28.09.2013	16:01:23	3000	99.74	EUR
IT0004775000	INTESA SANPAOLO ZC 05.12.2014	16:01:36	2000	97.35	EUR
IT0003618383	BTP 4,25% 01.08.14	16:01:36	100000	103.345	EUR
XS0852107266	BEI 2.75% 13.11.2023	16:01:41	50000	98.3	SEK
XS0461107905	BANCA IMI STEP UP FLOATER CAP 22.12.2015	16:01:49	50000	94.79	EUR
IT0004725914	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 30.06.2017	16:01:51	5000	100.28	EUR
IT0004725914	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 30.06.2017	16:01:51	11000	100.29	EUR
XS0501195480	REPUBBLICA ARGENTINA 8.75% 02.06.2017	16:02:05	9771	77.74	USD
IT0004546955	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 30.11.2015	16:02:08	12000	99.94	EUR
US298785FL50	BEI 1.25% 14.02.2014	16:02:12	13000	100.73	USD
IT0004626039	IMI EQUITY PROTECTION WORLD INDICES CAP 01.09.2016	16:02:12	50	113.57	EUR
IT0004350192	Unicredit 3,95% 30.04.2014	16:02:22	1000	102.48	EUR
XS0215301580	BEI 9,625% 01.04.2015	16:02:28	35000	105.92	TRY
IT0004806888	BTP ITALIA 2,45% 26.03.2016	16:02:29	5000	102.24	EUR
IT0004634132	BTP 3,75% 01.03.2021	16:02:29	25000	100.62	EUR
XS0460430142	BANCA IMI FIXED FLOATER CAP&FLOOR 18.12.2016	16:02:29	27000	98.3	EUR
XS0460430142	BANCA IMI FIXED FLOATER CAP&FLOOR 18.12.2016	16:02:29	19000	98.5	EUR
US0378331005	Apple	16:02:30	10	322.75	EUR

IT0004793805	INTESA SANPAOLO 4.3% 02.03.2014	16:02:36	15000	102.1	EUR
ES00000123P9	REGNO DI SPAGNA BONOS 3.75% 31.10.2015	16:02:36	7000	102.7	EUR
IT0006643032	Morgan Stanley FTSE MIB Floor 28.09.2013	16:02:41	20000	111.65	EUR
XS0215301580	BEI 9,625% 01.04.2015	16:02:50	5000	105.9	TRY
IT0004697022	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 31.03.2016	16:03:06	11000	100.69	EUR
IT0003472336	BTP 4.25% 01.08.13	16:03:07	10000	100.434	EUR
IT0004615305	UNICREDIT STEP UP AMORTISING SUB 14.06.2017 EUR	16:03:09	36000	101.2	EUR
IT0004843279	MPS 3.9% 01.10.2014	16:03:11	5000	100.61	EUR
XS0185490934	CITIGROUP FIXED FLOATER CALLABLE SUBORD 10.02.2019	16:03:11	10000	98	EUR
IT0004423957	BTP 4,5% 01.03.2019	16:03:11	250000	105.53	EUR
IT0004725914	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 30.06.2017	16:03:11	9000	100.5	EUR
IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	16:03:11	15000	100.71	EUR
XS0210918123	MPS 3,875% 02.02.15	16:03:11	7000	100.05	EUR
XS0210918123	MPS 3,875% 02.02.15	16:03:11	19000	100.03	EUR
XS0740832349	BANCA IMI EP EUR/USD 02.03.2015	16:03:11	23	1025.93	EUR
IT0003930507	Dexia Crediop Step Up Callable 31.10.13	16:03:11	25000	99.97	EUR
IT0003930507	Dexia Crediop Step Up Callable 31.10.13	16:03:11	7000	99.97	EUR
XS0491548870	DEUTSCHE BANK FIXED FLOATER CAP 04.05.2016	16:03:24	17000	98.18	EUR
IT0004692817	INTESA SANPAOLO TV AMRT SUB 31.03.2018	16:03:31	50000	96.5	EUR
XS0500187843	INTESA SANPAOLO 4.125% 14.04.2020	16:03:36	50000	102.03	EUR
IT0004531312	BANCA IMI TV CAP & FLOOR 30.10.2014	16:03:41	35000	99.9	EUR
DE0001030526	REPUBBLICA TEDESCA BUNDÇI 1.75% 15.04.2020	16:03:41	5000	114.92	EUR
US0258161092	AMERICAN EXPRESS CO.	16:03:41	80	55.48	EUR
IT0004917958	BTP ITALIA 2.25% 22.04.2017	16:03:41	163000	100.58	EUR
IT0006643040	Morgan Stanley FTSE MIB 28.09.2013	16:03:41	11000	99.74	EUR
IT0006643040	Morgan Stanley FTSE MIB 28.09.2013	16:03:41	21000	99.73	EUR
IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	16:03:41	200000	100.71	EUR
IT0004776230	UNICREDIT TV 19.12.2017	16:03:41	4000	96.68	EUR
IT0004713787	MEDIOBANCA - TV CAP & FLOOR 31.05.2017	16:03:41	5000	100.9	EUR
IT0004568371	UBI BANCA 3.15% 26.02.2016	16:03:41	18000	100.15	EUR
IT0004568371	UBI BANCA 3.15% 26.02.2016	16:03:41	10000	100.16	EUR
IT0004568371	UBI BANCA 3.15% 26.02.2016	16:03:41	12000	100.27	EUR
IT0004655483	CENTROBANCA FIXED FLOATER 20.12.2015	16:03:41	50000	94.68	EUR
IT0004816929	UNICREDIT 4.2% 12.06.2015	16:03:41	50000	103.09	EUR
IT0004628548	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 10.09.2016	16:03:41	15000	99.59	EUR
IT0004628548	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 10.09.2016	16:03:41	30000	99.6	EUR
IT0004628548	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 10.09.2016	16:03:41	5000	99.62	EUR
IT0004634132	BTP 3,75% 01.03.2021	16:03:41	42000	100.59	EUR
NL0009690593	REGNO D'OLANDA 1% 15.01.2014	16:03:41	30000	100.57	EUR
XS0367662987	Sns Bank TV 30.06.2014	16:03:41	2000	97.51	EUR
IT0004607302	UNICREDIT - TV CAP & FLOOR 31.05.2016 EUR	16:03:41	11000	93.06	EUR
IT0004607302	UNICREDIT - TV CAP & FLOOR 31.05.2016 EUR	16:03:41	9000	93.06	EUR
IT0004764004	UNICREDIT STEP UP AMRT SUB 31.10.2018	16:03:41	4000	103.61	EUR
DE000HV77964	UNICREDITBANK BONUS FTSE MIB 12.07.2013	16:03:41	50	109	EUR
IT0004923998	BTP 4.75% 01.09.2044	16:03:41	40000	97.37	EUR
IT0004785322	INTESA SANPAOLO ZC 06.02.2015	16:03:41	10000	96.78	EUR
XS0858481194	BEI 5.5% 28.11.2017	16:03:42	10000	96.6	TRY

IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	16:03:42	200000	100.69	EUR
IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	16:03:42	265000	100.71	EUR
XS0790004344	GE CAPITAL AUSTRALIA FUNDING 4.75% 14.06.2016	16:03:43	30000	103	AUD
IT0004634132	BTP 3,75% 01.03.2021	16:03:46	40000	100.59	EUR
XS0185490934	CITIGROUP FIXED FLOATER CALLABLE SUBORD 10.02.2019	16:03:58	30000	98.4	EUR
US36962GK948	GE Capital Corporation TV 15.09.2014	16:04:01	18000	100.18	USD
US36962GK948	GE Capital Corporation TV 15.09.2014	16:04:01	2000	100.19	USD
IT0004457807	Intesa Sanpaolo TV Amortising Sub. 24.02.2016	16:04:07	60000	101.53	EUR
IT0004644602	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 29.10.2016	16:04:07	4000	99.38	EUR
IT0004644602	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 29.10.2016	16:04:07	46000	99.39	EUR
IT0004762586	UNICREDIT FIXED FLOATER 30.09.2017	16:04:09	10000	99.89	EUR
IT0004762586	UNICREDIT FIXED FLOATER 30.09.2017	16:04:09	20000	99.88	EUR
US298785FL50	BEI 1.25% 14.02.2014	16:04:14	1000	100.73	USD
IT0004536949	BTP 4,25% 01.03.2020	16:04:15	200000	103.73	EUR
IT0004659758	CENTROBANCA - TV CAP & FLOOR 30.12.2016	16:04:18	20000	97.6	EUR
IT0004923998	BTP 4.75% 01.09.2044	16:04:25	50000	97.33	EUR
US90466MAC38	UNICREDIT LUXEMBOURG FINANCE 6% SUB 31.10.2017	16:04:26	100000	102.94	USD
IT0004490048	UNICREDIT 3,75% 29.08.2014	16:04:27	25000	102.51	EUR
XS0858481194	BEI 5.5% 28.11.2017	16:04:32	16000	96.6	TRY
IT0004653850	INTESA SANPAOLO TV CAP & FLOOR 03.12.2014	16:04:37	25000	100.84	EUR
IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	16:04:37	35000	100.74	EUR
IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	16:04:37	465000	100.74	EUR
XS0698632212	BEI 2.625% 15.03.2017	16:04:47	240000	102.54	SEK
XS0698632212	BEI 2.625% 15.03.2017	16:04:47	60000	102.54	SEK
XS0503833344	COMMONWEALTH BANK AUSTRALIA FIXED FLOAT 01.06.2016	16:04:49	30000	98.28	EUR
IT0004759673	BTP 5% 01.03.2022	16:04:51	30000	107.27	EUR
IT0006716580	HSBC BANK FIXED FLOATER 04.11.2016	16:05:02	5000	97.1	EUR
IT0003535157	BTP 5% 01.08.34	16:05:03	50000	102.84	EUR
IT0004899107	BOT ZC 30.09.2013	16:05:03	160000	99.884	EUR
IT0004787484	UNICREDIT 6% 31.07.2014	16:05:05	1000	104.86	EUR
IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	16:05:05	35000	100.74	EUR
IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	16:05:05	215000	100.74	EUR
IT0004649924	VENETO BANCA STEP UP 02.12.2015	16:05:06	7000	101.9	EUR
IT0000366655	BTP 9% 01.11.23	16:05:11	10000	139.42	EUR
IT0004713787	MEDIOBANCA - TV CAP & FLOOR 31.05.2017	16:05:13	9000	100.9	EUR
IT0004780380	BTP 6% 15.11.2014	16:05:13	3000	106.37	EUR
IT0004767809	VENETO BANCA 4.25% 02.05.2014	16:05:14	5000	100	EUR
IT0003934657	BTP 4% 01.02.37	16:05:18	76000	91.36	EUR
IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	16:05:18	85000	100.74	EUR
IT0004568371	UBI BANCA 3.15% 26.02.2016	16:05:18	28000	100.27	EUR
XS0362401480	Banca Imi TV Floor 30.06.2014	16:05:18	16000	102.07	EUR
XS0362401480	Banca Imi TV Floor 30.06.2014	16:05:18	14000	102.06	EUR
IT0004536162	UNICREDIT TV FLOOR 09.10.2015	16:05:18	10000	99.94	EUR
IT0004441009	Banca Imi TV Floor 02.02.2015	16:05:18	30000	103.08	EUR
IT0004812142	UNICREDIT 4% 09.05.2017	16:05:19	30000	102.48	EUR
US4581401001	Intel	16:05:19	70	18.8	EUR
IT0004644602	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 29.10.2016	16:05:19	3000	99.39	EUR

IT0004806888	BTP ITALIA 2,45% 26.03.2016	16:05:19	45000	102.23	EUR
IT0004806888	BTP ITALIA 2,45% 26.03.2016	16:05:19	5000	102.23	EUR
XS0520327502	DANSKE BANK FIXED FLOATER 20.07.2015	16:05:19	40000	97.85	EUR
IT0004793813	INTESA SANPAOLO 4% 02.03.2014	16:05:19	1000	101.89	EUR
AT0000383864	Rep Of Austria 6,25% 15.07.27	16:05:19	3000	148.08	EUR
XS0407006179	MEDIOBANCA AZIONI ITALIA CAP 06.02.2015	16:05:19	4000	97.29	EUR
XS0407006179	MEDIOBANCA AZIONI ITALIA CAP 06.02.2015	16:05:19	1000	97.29	EUR
IT0004775000	INTESA SANPAOLO ZC 05.12.2014	16:05:19	5000	97.35	EUR
ES00000122D7	REGNO DI SPAGNA -OBLIGACIONES 4% 30.04.2020 EUR	16:05:19	4000	99.62	EUR
XS0698632212	BEI 2.625% 15.03.2017	16:05:19	180000	102.54	SEK
IT0004594930	BTP 4% 01.09.2020	16:05:19	14000	102.2	EUR
XS0460430142	BANCA IMI FIXED FLOATER CAP&FLOOR 18.12.2016	16:05:19	4000	98.5	EUR
XS0460430142	BANCA IMI FIXED FLOATER CAP&FLOOR 18.12.2016	16:05:19	16000	98.29	EUR
IT0004806888	BTP ITALIA 2,45% 26.03.2016	16:05:19	6000	102.4	EUR
IT0004536949	BTP 4,25% 01.03.2020	16:05:19	200000	103.73	EUR
IT0004604671	BTPçì 2,1% 15.09.2021	16:05:19	30000	95.45	EUR
IT0004657471	BANCA POP DI VICENZA 4.60% AMRT SUB 15.12.2017	16:05:19	3000	101.07	EUR
IT0004657471	BANCA POP DI VICENZA 4.60% AMRT SUB 15.12.2017	16:05:19	2000	101.23	EUR
US0378331005	Apple	16:05:19	1	324.99	EUR
IT0006646480	Merrill Lynch 4% 28.09.2013	16:05:19	14000	100.64	EUR
XS0779340495	GLOBAL BOND SERIES XIV TV CAP & FLOOR 01.10.2019	16:05:19	10000	97.55	EUR
IT0004518574	UNICREDIT STEP UP 31.08.2015	16:05:19	15000	102.74	EUR
IT0004591795	BANCA IMI TV CAP & FLOOR 04.05.2016	16:05:20	9000	100.19	EUR
IT0004776230	UNICREDIT TV 19.12.2017	16:05:20	22000	96.89	EUR
IT0004776230	UNICREDIT TV 19.12.2017	16:05:20	20000	96.9	EUR
IT0004776230	UNICREDIT TV 19.12.2017	16:05:20	8000	96.9	EUR
IT0004842727	BANCA IMI 3.7% 12.09.2014	16:05:20	5000	102.47	EUR
IT0004164775	BTP 4% 01.02.17	16:05:20	14000	104.438	EUR
IT0004889165	BANCO POPOLARE FIXED FLOATER 27.02.2018	16:05:20	5000	100	EUR
IT0004781370	INTESA SANPAOLO TV FLOOR 28.12.2013	16:05:20	20000	102.85	EUR
XS0379218315	Mediobanca TV Cap&Floor 30.09.2014	16:05:20	20000	102.6	EUR
IT0004605074	UNICREDIT STEP UP AMORTISING SUB 31.05.2020 EUR	16:05:20	20000	100.71	EUR
IT0003472336	BTP 4.25% 01.08.13	16:05:20	6000	100.434	EUR
IT0004867070	BTP 3.5% 01.11.2017	16:05:20	79000	101.9	EUR
US36962GU517	GE Capital Corporation TV 08.01.2016	16:05:20	100000	99.66	USD
IT0004780562	UNICREDIT SPA STEP UP AMRT SUB 31.01.2019	16:05:20	10000	107.59	EUR
XS0306644930	Enel TV 20.06.2014	16:05:20	100000	99.46	EUR
IT0004292683	Enel 5,25% 14.01.2015	16:05:20	15000	106.02	EUR
IT0004536949	BTP 4,25% 01.03.2020	16:05:20	200000	103.72	EUR
XS0348747865	Goldman Sachs 4,05% 31.03.2014	16:05:20	9000	102.63	EUR
IT0004497076	UNICREDIT TV FLOOR 26.06.2015	16:05:20	11000	101.96	EUR
IT0004497076	UNICREDIT TV FLOOR 26.06.2015	16:05:20	20000	101.82	EUR
IT0004497076	UNICREDIT TV FLOOR 26.06.2015	16:05:20	30000	101.8	EUR
IT0004497076	UNICREDIT TV FLOOR 26.06.2015	16:05:20	2000	101.8	EUR
IT0004497076	UNICREDIT TV FLOOR 26.06.2015	16:05:20	2000	101.8	EUR
IT0004634132	BTP 3,75% 01.03.2021	16:05:20	30000	100.57	EUR
XS0336285100	Mediobanca TV Floor 15.02.2014	16:05:20	20000	101.09	EUR

IT0004273493	BTP 4,5% 01.02.2018	16:05:20	250000	106.13	EUR
IT0004866551	BANCO POPOLARE TV CAP & FLOOR 06.12.2017	16:05:20	10000	101.45	EUR
IT0004672215	INTESA SANPAOLO TV CAP & FLOOR 03.02.2015	16:05:21	20000	101.68	EUR
IT0004536162	UNICREDIT TV FLOOR 09.10.2015	16:05:21	10000	99.94	EUR
IT0004616014	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 30.06.2016	16:05:21	8000	97.96	EUR
IT0004616014	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 30.06.2016	16:05:21	8000	97.95	EUR
IT0004616014	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 30.06.2016	16:05:21	2000	97.92	EUR
IT0004644735	BTP 4,50% 01.03.2026	16:05:21	100000	101.71	EUR
IT0004898034	BTP 4.5% 01.05.2023	16:05:21	20000	102.25	EUR
DE0001135416	REPUBBLICA TEDESCA BUND 2.25% 04.09.2020	16:05:21	10000	109.09	EUR
IT0004490048	UNICREDIT 3,75% 29.08.2014	16:05:21	20000	102.52	EUR
US922646AS37	Venezuela 9,25% 15.09.27	16:05:21	9000	88.9	USD
US922646AS37	Venezuela 9,25% 15.09.27	16:05:21	3000	88.9	USD
US922646AS37	Venezuela 9,25% 15.09.27	16:05:21	2000	88.98	USD
US922646AS37	Venezuela 9,25% 15.09.27	16:05:21	10000	89	USD
US922646AS37	Venezuela 9,25% 15.09.27	16:05:21	3000	89	USD
IT0004503766	ENI TV 29.06.2015	16:05:21	6000	100.81	EUR
IT0004659758	CENTROBANCA - TV CAP & FLOOR 30.12.2016	16:05:21	50000	97.6	EUR
IT0004854094	INTESA SANPAOLO 4% 05.11.2017	16:05:21	8000	102.05	EUR
IT0004762578	UNICREDIT TV 31.10.2017	16:05:21	11000	96.54	EUR
IT0004027105	Dexia Crediop Step Up Multicallable 31.03.14	16:05:21	5000	100.52	EUR
IT0004764541	BANCA IMI TV FLOOR 31.12.2013	16:05:21	5000	101.71	EUR
IT0004787484	UNICREDIT 6% 31.07.2014	16:05:21	1000	104.86	EUR
IT0004805070	BTP 2,5% 01.03.2015	16:05:22	7000	101.351	EUR
US36962GU517	GE Capital Corporation TV 08.01.2016	16:05:22	30000	99.66	USD
XS0883880469	BANCA IMI EP EUROSTOXX OIL&GAS 06.03.2018	16:05:22	10	952.51	EUR
IT0003934657	BTP 4% 01.02.37	16:05:22	20000	91.36	EUR
IT0003242747	BTP 5,25% 01.08.17	16:05:22	4000	108.85	EUR
XS0898281125	BANCA IMI EQUITY PROTECTION CPI 10.04.2017	16:05:22	15	957.1	EUR
IT0004872765	BANCA IMI EURIBOR 18.01.2017	16:05:22	10000	100.3	EUR
IT0004576994	ENEL TV 26.02.2016	16:05:22	5000	98.17	EUR
IT0004591795	BANCA IMI TV CAP & FLOOR 04.05.2016	16:05:22	21000	100.2	EUR
IT0004591795	BANCA IMI TV CAP & FLOOR 04.05.2016	16:05:22	12000	100.39	EUR
IT0004591795	BANCA IMI TV CAP & FLOOR 04.05.2016	16:05:22	46000	100.4	EUR
IT0004591795	BANCA IMI TV CAP & FLOOR 04.05.2016	16:05:22	19000	100.42	EUR
IT0004591795	BANCA IMI TV CAP & FLOOR 04.05.2016	16:05:22	22000	100.5	EUR
IT0004759673	BTP 5% 01.03.2022	16:05:22	13000	107.23	EUR
IT0004653850	INTESA SANPAOLO TV CAP & FLOOR 03.12.2014	16:05:22	25000	100.84	EUR
FR0011439975	PEUGEOT 7.375% 06.03.2018	16:05:22	10000	103.74	EUR
IT0004644735	BTP 4,50% 01.03.2026	16:05:22	10000	101.71	EUR
XS0336285100	Mediobanca TV Floor 15.02.2014	16:05:22	5000	101.09	EUR
US36962GU517	GE Capital Corporation TV 08.01.2016	16:05:23	50000	99.66	USD
IT0004432065	Intesa Sanpaolo TV Floor 30.12.2014	16:05:23	4000	103.51	EUR
IT0004749930	INTESA SANPAOLO 4.2% 12.09.2013	16:05:23	1000	100.76	EUR
IT0004432065	Intesa Sanpaolo TV Floor 30.12.2014	16:05:23	80000	103.51	EUR
XS0765617377	BANCA IMI EQUITY PROTECTION FTSE MIB 04.05.2017	16:05:23	5	1035.98	EUR
IT0004781370	INTESA SANPAOLO TV FLOOR 28.12.2013	16:05:23	6000	102.86	EUR

IT0004615917	BTP 3% 15.06.2015	16:05:24	15000	102.14	EUR
XS0782699366	MERCEDES-BENZ AUSTRALIA PACIFIC 4.5% 18.05.2015	16:05:24	6000	102.7	AUD
IT0004842685	BANCA IMI 5% 12.09.2017	16:05:24	4000	106.27	EUR
IT0004633993	INTESA SANPAOLO TV CAP & FLOOR 04.10.2017	16:05:24	10000	99.87	EUR
IT0004633993	INTESA SANPAOLO TV CAP & FLOOR 04.10.2017	16:05:24	10000	99.81	EUR
IT0004887896	INTESA SANPAOLO STEP UP 08.02.2019	16:05:24	6000	98.6	EUR
IT0004871965	INTESA SANPAOLO STEP UP 18.01.2019	16:05:24	9000	101.55	EUR
IT0003934657	BTP 4% 01.02.37	16:05:24	10000	91.37	EUR
XS0450785075	DEUTSCHE BANK 3% 30.10.2015	16:05:24	20000	104.72	EUR
IT0004870751	BANCA POPOLARE DI VICENZA 2.5% 30.12.2014	16:05:24	4000	99.5	EUR
IT0004689755	MEDIOBANCA TV CAP & FLOOR 31.03.2017	16:05:24	2000	100.52	EUR
IT0004689755	MEDIOBANCA TV CAP & FLOOR 31.03.2017	16:05:24	13000	100.51	EUR
IT0004689755	MEDIOBANCA TV CAP & FLOOR 31.03.2017	16:05:25	2000	100.51	EUR
IT0004689755	MEDIOBANCA TV CAP & FLOOR 31.03.2017	16:05:25	9000	100.5	EUR
IT0004689755	MEDIOBANCA TV CAP & FLOOR 31.03.2017	16:05:25	16000	100.48	EUR
IT0004689755	MEDIOBANCA TV CAP & FLOOR 31.03.2017	16:05:25	4000	100.46	EUR
IT0004689755	MEDIOBANCA TV CAP & FLOOR 31.03.2017	16:05:25	16000	100.46	EUR
XS0465797552	Deutsche Bank Step Up 01.02.2016	16:05:25	10000	105.23	EUR
IT0004851231	INTESA SANPAOLO TV 25.10.2017	16:05:25	7000	105.5	EUR
IE00B4TV0D44	Repubblica Irlandese 5,4% 13.03.2025	16:05:25	5000	110.92	EUR
IT0003934657	BTP 4% 01.02.37	16:05:25	1000	91.28	EUR
IT0004672215	INTESA SANPAOLO TV CAP & FLOOR 03.02.2015	16:05:25	10000	101.68	EUR
IT0004867070	BTP 3.5% 01.11.2017	16:05:25	21000	101.9	EUR
IT0004785322	INTESA SANPAOLO ZC 06.02.2015	16:05:25	6000	96.78	EUR
XS0390338019	Banca Imi ZC 03.12.2013	16:05:25	2000	99.52	EUR
XS0201271045	Intesa Sanpaolo TV 01.10.2014	16:05:25	6000	98.97	EUR
IT0004615305	UNICREDIT STEP UP AMORTISING SUB 14.06.2017 EUR	16:05:25	8000	101.01	EUR
IT0004866353	INTESA SANPAOLO STEP UP 04.12.2018	16:05:25	1000	101.54	EUR
IT0004620305	CCT EU FRN 15.12.2015	16:05:26	5000	98.12	EUR
IT0004576978	ENEL 3.5% 26.02.2016	16:05:26	41000	103.54	EUR
XS0162420045	BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN ZC 20.12.2018	16:05:26	10000	82.28	AUD
IT0004759673	BTP 5% 01.03.2022	16:05:26	3000	107.23	EUR
DE0001135382	BUND 3,5% 04.07.2019	16:05:26	500000	116.29	EUR
IT0004806888	BTP ITALIA 2,45% 26.03.2016	16:05:27	20000	102.3	EUR
IT0004634132	BTP 3,75% 01.03.2021	16:05:28	25000	100.57	EUR
IT0004659758	CENTROBANCA - TV CAP & FLOOR 30.12.2016	16:05:33	64000	97.6	EUR
XS0210870415	BANCA POP DI VICENZA TV CALL SUB 03.02.2015	16:05:33	5000	95.33	EUR
XS0881547466	VENETO BANCA 4% 31.07.2015	16:05:33	100000	100.54	EUR
XS0210918123	MPS 3,875% 02.02.15	16:05:35	5000	100.15	EUR
XS0222189564	Italy CMS Cap&Floor 15.06.2020	16:05:36	40000	91.8	EUR
XS0222189564	Italy CMS Cap&Floor 15.06.2020	16:05:36	40000	91.86	EUR
XS0222189564	Italy CMS Cap&Floor 15.06.2020	16:05:36	20000	91.89	EUR
IT0004907843	BTP 3.5% 01.06.2018	16:05:37	30000	101.43	EUR
IT0004009673	BTP 3,75% 01.08.21	16:05:37	50000	100.69	EUR
IT0004689755	MEDIOBANCA TV CAP & FLOOR 31.03.2017	16:05:38	5000	100.46	EUR
IT0004787484	UNICREDIT 6% 31.07.2014	16:05:38	19000	104.87	EUR
IT0003493258	BTP 4,25% 01.02.19	16:05:40	14000	104.48	EUR

IT0004546955	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 30.11.2015	16:05:43	27000	99.94	EUR
IT0004644735	BTP 4,50% 01.03.2026	16:05:43	25000	101.75	EUR
US465410BG26	Italy 5.375% 15.06.33	16:05:43	15000	105.9	USD
IT0003242747	BTP 5,25% 01.08.17	16:05:44	19000	108.85	EUR
XS0858481194	BEI 5.5% 28.11.2017	16:05:44	8000	96.23	TRY
XS0647264398	FIAT FINANCE & TRADE 7.375% 09.07.2018	16:05:48	100000	107.02	EUR
XS0596563410	BANCA IMI EP HANG SENG CHINA ENT 31.03.2017	16:05:48	50	930.88	EUR
IT0004866551	BANCO POPOLARE TV CAP & FLOOR 06.12.2017	16:06:00	5000	101.45	EUR
IT0003934657	BTP 4% 01.02.37	16:06:01	20000	91.37	EUR
IT0004532559	BTP 5% 01.09.2040	16:06:02	20000	101.67	EUR
IT0004793813	INTESA SANPAOLO 4% 02.03.2014	16:06:03	10000	101.89	EUR
IT0004644602	UNICREDIT TV CAP & FLOOR 29.10.2016	16:06:07	1000	99.39	EUR
XS0336285878	Mediobanca Eurostoxx50 15.02.2014	16:06:12	10000	98.76	EUR
IT0004672215	INTESA SANPAOLO TV CAP & FLOOR 03.02.2015	16:06:13	80000	101.68	EUR
IT0004568371	UBI BANCA 3.15% 26.02.2016	16:06:18	10000	100.27	EUR
IT0004776230	UNICREDIT TV 19.12.2017	16:06:19	20000	96.93	EUR
IT0003934657	BTP 4% 01.02.37	16:06:26	30000	91.37	EUR
XS0082720698	INTERNAT BANK RECONSTRUCT DEVELOP ZC 29.12.2028	16:06:28	30000	32.7	ZAR
US91086QAG38	Mexican States 8,3% 15.08.31	16:06:37	1000	149.79	USD
IT0004909013	INTESA SANPAOLO TV 15.05.2018	16:06:37	10000	100.51	EUR
XS0210918123	MPS 3,875% 02.02.15	16:06:38	40000	100.22	EUR
XS0201271045	Intesa Sanpaolo TV 01.10.2014	16:06:52	12000	98.95	EUR
IT0004917958	BTP ITALIA 2.25% 22.04.2017	16:07:00	69000	100.52	EUR
PTOTE50E0007	Republic of Portugal 4,1% 15.04.37	16:07:05	10000	71.87	EUR
XS0083585595	DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK REVERSE FLOATER 30.01.2018	16:07:16	8000000	131.98	ITL