

| ISIN         | Descrizione                               | Valuta | Prezzo Medio Ponderato | Prezzo Min | Prezzo Max | Prezzo Ultimo Contratto | Numero Contratti | Quantità negoziata | Controvalore |
|--------------|-------------------------------------------|--------|------------------------|------------|------------|-------------------------|------------------|--------------------|--------------|
| US465410BG26 | REP OF ITALY<br>5,375%<br>15/06/33<br>USD | USD    | 102,9238               |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810RK60 | T BOND<br>2,50%<br>15/2/45 USD            | USD    | 68,843                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912828J272 | T BOND 2%<br>15/2/25 USD                  | USD    | 97,432                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810FT08 | T BOND<br>4,5%<br>15/02/36<br>USD         | USD    | 99,74395               | 100,625    | 100,625    | 100,625                 | 1                | 25.000             | 23.471,03004 |
| US912810QZ49 | T BOND<br>3,125%<br>15/02/43<br>USD       | USD    | 78,3085                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810RB61 | T BOND<br>2,875%<br>15/05/43<br>USD       | USD    | 75,0665                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810RC45 | T BOND<br>3,625%<br>15/08/43<br>USD       | USD    | 84,122                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810RM27 | T BOND 3%<br>15/5/45 USD                  | USD    | 75,1415                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912828XB14 | T BOND<br>2,125%<br>15/5/25 USD           | USD    | 96,8924                |            |            |                         |                  |                    |              |

| ISIN         | Descrizione                                  | Valuta | Prezzo Medio Ponderato | Prezzo Min | Prezzo Max | Prezzo Ultimo Contratto | Numero Contratti | Quantità negoziata | Controvalore |
|--------------|----------------------------------------------|--------|------------------------|------------|------------|-------------------------|------------------|--------------------|--------------|
| XS1085735899 | PORTUGAL<br>5,125%<br>15/10/2024<br>USD      | USD    | 99,885                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810EW46 | T BOND<br>6,00%<br>15/02/2026<br>USD         | USD    | 101,9455               |            |            |                         |                  |                    |              |
| US465410BX58 | REP OF<br>ITALY<br>2,375%<br>17/10/24<br>USD | USD    | 98,6191                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US465410BY32 | REP OF<br>ITALY<br>2,875%<br>17/10/29<br>USD | USD    | 87,7283                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810FM54 | T BOND<br>6,25%<br>15/05/2030<br>USD         | USD    | 108,0885               |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912828G385 | T NOTE<br>2,25%<br>15/11/2024<br>USD         | USD    | 98,3774                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810FP85 | T BOND<br>5,375%<br>15/02/2031<br>USD        | USD    | 104,55                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810QN19 | T BOND<br>4,75%<br>15/02/2041<br>USD         | USD    | 99,4035                |            |            |                         |                  |                    |              |

| ISIN         | Descrizione                           | Valuta | Prezzo Medio Ponderato | Prezzo Min | Prezzo Max | Prezzo Ultimo Contratto | Numero Contratti | Quantità negoziata | Controvalore |
|--------------|---------------------------------------|--------|------------------------|------------|------------|-------------------------|------------------|--------------------|--------------|
| US912810QU51 | T BOND<br>3,125%<br>15/02/2042<br>USD | USD    | 79,2675                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810RS96 | T BOND<br>2,50%<br>15/05/2046<br>USD  | USD    | 67,8005                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810RX81 | T BOND<br>3,00%<br>15/05/2047<br>USD  | USD    | 73,8745                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810SE91 | T BOND<br>3,375%<br>15/11/2048<br>USD | USD    | 78,5                   |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810SJ88 | T BOND<br>2,25%<br>15/08/2049<br>USD  | USD    | 62,27                  |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810SL35 | T BOND<br>2,00%<br>15/02/2050<br>USD  | USD    | 58,399                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912828ZB95 | T NOTE<br>1,125%<br>28/02/2027<br>USD | USD    | 90,2345                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810RG58 | T BOND<br>3,375%<br>15/05/44<br>USD   | USD    | 80,608                 |            |            |                         |                  |                    |              |

| ISIN         | Descrizione                                 | Valuta | Prezzo Medio Ponderato | Prezzo Min | Prezzo Max | Prezzo Ultimo Contratto | Numero Contratti | Quantità negoziata | Controvalore |
|--------------|---------------------------------------------|--------|------------------------|------------|------------|-------------------------|------------------|--------------------|--------------|
| US9128282A70 | T NOTE<br>1,50%<br>15/08/2026<br>USD        | USD    | 92,5785                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810QE10 | T BOND<br>4,625%<br>15/02/2040<br>USD       | USD    | 98,483                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810RH32 | T BOND<br>3,125%<br>15/08/2044<br>USD       | USD    | 77,277                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810RJ97 | T BOND<br>3,00%<br>15/11/2044<br>USD        | USD    | 75,4945                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US465410BZ07 | REP OF<br>ITALY<br>4,00%<br>17/10/49<br>USD | USD    | 70,828                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810FJ26 | T BOND<br>6,125%<br>15/08/2029<br>USD       | USD    | 106,636                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810PX00 | T BOND<br>4,50%<br>15/05/2038<br>USD        | USD    | 98,287                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810QK79 | T BOND<br>3,875%<br>15/08/2040<br>USD       | USD    | 89,6385                |            |            |                         |                  |                    |              |

| ISIN         | Descrizione                           | Valuta | Prezzo Medio Ponderato | Prezzo Min | Prezzo Max | Prezzo Ultimo Contratto | Numero Contratti | Quantità negoziata | Controvalore |
|--------------|---------------------------------------|--------|------------------------|------------|------------|-------------------------|------------------|--------------------|--------------|
| US912810RE01 | T BOND<br>3,625%<br>15/02/2044<br>USD | USD    | 83,867                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810RN00 | T BOND<br>2,875%<br>15/08/2045<br>USD | USD    | 73,3295                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US9128286B18 | T NOTE<br>2,625%<br>15/02/2029<br>USD | USD    | 91,1125                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US9128286T26 | T NOTE<br>2,375%<br>15/05/2029<br>USD | USD    | 89,663                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912828WJ58 | T NOTE<br>2,50%<br>15/05/2024<br>USD  | USD    | 100,13283              |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912828YB05 | T NOTE<br>1,625%<br>15/08/2029<br>USD | USD    | 85,8935                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912828YS30 | T NOTE<br>1,75%<br>15/11/2029<br>USD  | USD    | 86,1                   |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912828Z948 | T NOTE<br>1,50%<br>15/02/2030<br>USD  | USD    | 83,98                  |            |            |                         |                  |                    |              |

| ISIN         | Descrizione                           | Valuta | Prezzo Medio Ponderato | Prezzo Min | Prezzo Max | Prezzo Ultimo Contratto | Numero Contratti | Quantità negoziata | Controvalore |
|--------------|---------------------------------------|--------|------------------------|------------|------------|-------------------------|------------------|--------------------|--------------|
| US912828ZC78 | T NOTE<br>1,125%<br>28/02/2025<br>USD | USD    | 96,6625                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810FG86 | T BOND<br>5,25%<br>15/02/2029<br>USD  | USD    | 102,3435               |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810TM09 | T BOND<br>4,00%<br>15/11/2042<br>USD  | USD    | 89,3275                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810TN81 | T BOND<br>3,625%<br>15/02/2053<br>USD | USD    | 81,9605                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810TQ13 | T BOND<br>3,875%<br>15/02/2043<br>USD | USD    | 87,5815                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CFY21 | T NOTE<br>3,875%<br>30/11/2029<br>USD | USD    | 95,96795               |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CGB19 | T NOTE<br>3,875%<br>30/12/2029<br>USD | USD    | 95,8949                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CGJ45 | T NOTE<br>3,50%<br>31/01/2030<br>USD  | USD    | 93,9807                |            |            |                         |                  |                    |              |

| ISIN         | Descrizione                           | Valuta | Prezzo Medio Ponderato | Prezzo Min | Prezzo Max | Prezzo Ultimo Contratto | Numero Contratti | Quantità negoziata | Controvalore |
|--------------|---------------------------------------|--------|------------------------|------------|------------|-------------------------|------------------|--------------------|--------------|
| US91282CGM73 | T NOTE<br>3,50%<br>15/02/2033<br>USD  | USD    | 91,59375               |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CGP05 | T NOTE<br>4,00%<br>29/02/2028<br>USD  | USD    | 97,27355               |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CGQ87 | T NOTE<br>4,00%<br>28/02/2030<br>USD  | USD    | 96,4328                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CFX48 | T NOTE<br>4,50%<br>30/11/2024<br>USD  | USD    | 99,5181                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CFZ95 | T NOTE<br>3,875%<br>30/11/2027<br>USD | USD    | 96,9539                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CGA36 | T NOTE<br>4,00%<br>15/12/2025<br>USD  | USD    | 98,2779                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CGC91 | T NOTE<br>3,875%<br>31/12/2027<br>USD | USD    | 96,9106                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CGD74 | T NOTE<br>4,25%<br>31/12/2024<br>USD  | USD    | 99,3094                |            |            |                         |                  |                    |              |

| ISIN         | Descrizione                           | Valuta | Prezzo Medio Ponderato | Prezzo Min | Prezzo Max | Prezzo Ultimo Contratto | Numero Contratti | Quantità negoziata | Controvalore |
|--------------|---------------------------------------|--------|------------------------|------------|------------|-------------------------|------------------|--------------------|--------------|
| US91282CGE57 | T NOTE<br>3,875%<br>15/01/2026<br>USD | USD    | 98,0209                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CGG06 | T NOTE<br>4,125%<br>31/01/2025<br>USD | USD    | 99,14435               |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CGH88 | T NOTE<br>3,50%<br>31/01/2028<br>USD  | USD    | 95,58235               |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CGL90 | T NOTE<br>4,00%<br>15/02/2026<br>USD  | USD    | 98,1904                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CGN56 | T NOTE<br>4,625%<br>28/02/2025<br>USD | USD    | 99,4782                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810FF04 | T BOND<br>5,25%<br>15/11/2028<br>USD  | USD    | 102,1521               |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810QL52 | T BOND<br>4,25%<br>15/11/2040<br>USD  | USD    | 93,6835                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810SP49 | T BOND<br>1,375%<br>15/08/2050<br>USD | USD    | 48,984                 |            |            |                         |                  |                    |              |

| ISIN         | Descrizione                           | Valuta | Prezzo Medio Ponderato | Prezzo Min | Prezzo Max | Prezzo Ultimo Contratto | Numero Contratti | Quantità negoziata | Controvalore |
|--------------|---------------------------------------|--------|------------------------|------------|------------|-------------------------|------------------|--------------------|--------------|
| US912810TG31 | T BOND<br>2,875%<br>15/05/2052<br>USD | USD    | 70,5905                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912828D564 | T NOTE<br>2,375%<br>15/08/2024<br>USD | USD    | 99,13525               |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912828YE44 | T NOTE<br>1,25%<br>31/08/2024<br>USD  | USD    | 98,65                  |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CCT62 | T NOTE<br>0,375%<br>15/08/2024<br>USD | USD    | 98,5723                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CED92 | T NOTE<br>1,75%<br>15/03/2025<br>USD  | USD    | 97,03855               |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CEF41 | T NOTE<br>2,50%<br>31/03/2027<br>USD  | USD    | 93,68515               |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CEH07 | T NOTE<br>2,625%<br>15/04/2025<br>USD | USD    | 97,59255               |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CEM91 | T NOTE<br>2,875%<br>30/04/2029<br>USD | USD    | 91,8679                |            |            |                         |                  |                    |              |

| ISIN         | Descrizione                           | Valuta | Prezzo Medio Ponderato | Prezzo Min | Prezzo Max | Prezzo Ultimo Contratto | Numero Contratti | Quantità negoziata | Controvalore |
|--------------|---------------------------------------|--------|------------------------|------------|------------|-------------------------|------------------|--------------------|--------------|
| US91282CEN74 | T NOTE<br>2,75%<br>30/04/2027<br>USD  | USD    | 94,1809                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CEP23 | T NOTE<br>2,875%<br>15/05/2032<br>USD | USD    | 87,97035               |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CEQ06 | T NOTE<br>2,75%<br>15/05/2025<br>USD  | USD    | 97,5226                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CER88 | T NOTE<br>2,50%<br>31/05/2024<br>USD  | USD    | 99,7671                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CET45 | T NOTE<br>2,625%<br>31/05/2027<br>USD | USD    | 93,69915               |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CEU18 | T NOTE<br>2,875%<br>15/06/2025<br>USD | USD    | 97,472                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810FE39 | T BOND<br>5,50%<br>15/08/2028<br>USD  | USD    | 103,129                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810PT97 | T BOND<br>4,75%<br>15/02/2037<br>USD  | USD    | 101,7                  |            |            |                         |                  |                    |              |

| ISIN         | Descrizione                           | Valuta | Prezzo Medio Ponderato | Prezzo Min | Prezzo Max | Prezzo Ultimo Contratto | Numero Contratti | Quantità negoziata | Controvalore |
|--------------|---------------------------------------|--------|------------------------|------------|------------|-------------------------|------------------|--------------------|--------------|
| US912810PU60 | T BOND<br>5,00%<br>15/05/2037<br>USD  | USD    | 103,899                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810QB70 | T BOND<br>4,25%<br>15/05/2039<br>USD  | USD    | 94,8595                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810QD37 | T BOND<br>4,375%<br>15/11/2039<br>USD | USD    | 95,8505                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810QH41 | T BOND<br>4,375%<br>15/05/2040<br>USD | USD    | 95,531                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810RD28 | T BOND<br>3,75%<br>15/11/2043<br>USD  | USD    | 85,537                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810RU43 | T BOND<br>2,875%<br>15/11/2046<br>USD | USD    | 72,487                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810SK51 | T BOND<br>2,375%<br>15/11/2049<br>USD | USD    | 63,961                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810SN90 | T BOND<br>1,25%<br>15/05/2050<br>USD  | USD    | 47,4615                |            |            |                         |                  |                    |              |

| ISIN         | Descrizione                           | Valuta | Prezzo Medio Ponderato | Prezzo Min | Prezzo Max | Prezzo Ultimo Contratto | Numero Contratti | Quantità negoziata | Controvalore |
|--------------|---------------------------------------|--------|------------------------|------------|------------|-------------------------|------------------|--------------------|--------------|
| US912810SS87 | T BOND<br>1,625%<br>15/11/2050<br>USD | USD    | 52,4565                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810SX72 | T BOND<br>2,375%<br>15/05/2051<br>USD | USD    | 63,3055                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810SY55 | T BOND<br>2,25%<br>15/05/2041<br>USD  | USD    | 69,907                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810SZ21 | T BOND<br>2,00%<br>15/08/2051<br>USD  | USD    | 57,6135                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810TA60 | T BOND<br>1,75%<br>15/08/2041<br>USD  | USD    | 63,711                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810TB44 | T BOND<br>1,875%<br>15/11/2051<br>USD | USD    | 55,6325                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810TC27 | T BOND<br>2,00%<br>15/11/2041<br>USD  | USD    | 66,2605                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810TD00 | T BOND<br>2,25%<br>15/02/2052<br>USD  | USD    | 61,177                 |            |            |                         |                  |                    |              |

| ISIN         | Descrizione                           | Valuta | Prezzo Medio Ponderato | Prezzo Min | Prezzo Max | Prezzo Ultimo Contratto | Numero Contratti | Quantità negoziata | Controvalore |
|--------------|---------------------------------------|--------|------------------------|------------|------------|-------------------------|------------------|--------------------|--------------|
| US912810TH14 | T BOND<br>3,25%<br>15/05/2042<br>USD  | USD    | 80,533                 |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912810TV08 | T BOND<br>4,75%<br>15/11/2053<br>USD  | USD    | 99,7575                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US912828Z781 | T NOTE<br>1,50%<br>31/01/2027<br>USD  | USD    | 91,3955                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CDJ71 | T NOTE<br>1,375%<br>15/11/2031<br>USD | USD    | 79,2555                |            |            |                         |                  |                    |              |
| US91282CDY49 | T NOTE<br>1,875%<br>15/02/2032<br>USD | USD    | 81,8875                |            |            |                         |                  |                    |              |