

Korrekturjournal - Journal de corrections - Giornale di correzione

Die korrigierten Angaben zu einem Titel sind im Korrekturjournal fett markiert / les éléments corrigés d'un titre sont marqués en gras sur le journal de corrections / Gli elementi corretti di un titolo sono segnalati in grassetto su le giornale di correzione

Inhaltsverzeichnis - Table des matières - Indice

Ausland	Derivative Finanzinstrumente	Kombinierte Produkte (B-Z)	
Etranger	Produits financiers dérivés	Produits combinés (B-Z)	
Eestero	Strumenti finanziari derivati	Prodotti combinati (B-Z)	2 - 13

**Derivative Finanzinstrumente (Ausland) / Produits financiers
dérivés (Etranger) / Strumenti finanziari derivati (Estero)**

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante oblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a u c
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF					
Bank of Scotland, Edinburgh, Grossbritannien (2 1/2 % min./10 % max.) Notes Variable Rate Reg-S Series EURO 0994/05	EUR	1'000.00	07.02.2005	07.02.2035	2 056 765	%	112.05	100.00	100.00	07.02.	27.586	N

**Derivative Finanzinstrumente (Ausland) / Produits financiers
dérivés (Etranger) / Strumenti finanziari derivati (Estero)**

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a u r
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF					
HSBC Bank PLC, London, Grossbritannien												
Early Redemption Perles + on FTSE 100 Index Senior	USD	1'000.00	02.09.2014	05.09.2017	24 587 320	CHF	1'042.34	96.65	100.00		0.000	Y
Maxi Autocallable Recovery short DI put VRN on a Basket of Indices	USD	1'000.00	13.10.2015	12.10.2017	29 438 368	%	100.61	98.60	100.00		0.000	Y
Maxi Autocallable Recovery short DI put Notes VRN on a Basket of Shs Senior	USD	1'000.00	10.11.2014	13.11.2017	25 717 097	%	98.80	96.61	100.00		0.000	Y

**Derivative Finanzinstrumente (Ausland) / Produits financiers
dérivés (Etranger) / Strumenti finanziari derivati (Estero)**

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a c
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF					
J.P.Morgan Structured Products B.V., Amsterdam, Niederlande Phoenix Autocall Certificates VRN on a Basket of Indices	USD	1'000.00	21.01.2016	21.01.2019	29 519 364	%	97.06	96.659	100.00		0.000	Y

**Derivative Finanzinstrumente (Ausland) / Produits financiers
dérivés (Etranger) / Strumenti finanziari derivati (Estero)**

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a u
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%	CHF/%		
Leonteq Securities AG, Guernsey Branch, Guernsey												
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.08.2015	25.11.2016	25 406 628		-	99.18	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.07.2015	03.01.2017	28 154 462	%	99.10	99.87	100.00		0.000	Y
Express Certificate on Saint Gobain	EUR	1'000.00	28.01.2014	20.01.2017	22 851 743	%	107.49	97.97	100.00		0.000	Y
Capital Protection-Cert.	GBP	1'000.00	31.01.2014	31.01.2017	22 850 858	%	110.33	86.50	90.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.12.2014	21.02.2017	25 609 244	%	0.02	98.11	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Microsoft	USD	1'000.00	09.11.2015	09.05.2017	25 406 900	%	97.81	98.96	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	17.02.2016	17.05.2017	30 460 542	%	96.95	99.11	100.00		0.000	Y
Express Certificate 2014-15.05.17 on Equities	USD	1'000.00	20.05.2014	22.05.2017	24 203 691	%	97.37	97.26	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.01.2016	11.07.2017	30 039 672	%	98.41	100.00	100.00	08.12.	0.000	Y
6.4 % Barrier Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	17.01.2014	17.07.2017	22 851 328	%	102.77	100.00	100.00	16.01.	1.800	N
										16.07.	1.800	
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.01.2016	20.07.2017	25 407 136	%	101.78	98.65	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.05.2016	31.08.2017	26 668 995	%	97.84	98.97	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	01.09.2015	01.09.2017	25 406 651	%	99.29	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.09.2015	11.09.2017	26 668 746	%	85.34	98.34	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.09.2014	18.09.2017	24 533 111	%	47.41	99.22	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.05.2016	06.11.2017	26 668 975	%	96.98	98.69	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.11.2015	10.11.2017	26 668 938	%	99.49	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	CHF	1'000.00	22.12.2015	22.12.2017	30 460 397	%	86.82	100.00	100.00		0.000	Y
9.55 % (9.42 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.12.2016	05.01.2018	34 820 216	%	106.30	100.00	100.00		0.000	Y
11.05 % (10.9 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.12.2016	05.01.2018	34 820 215	%	107.26	100.00	100.00		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	04.05.2015	04.05.2018	26 668 540	%	116.12	100.00	100.00		0.000	Y

**Derivative Finanzinstrumente (Ausland) / Produits financiers
dérivés (Etranger) / Strumenti finanziari derivati (Estero)**
Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a u
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%			
Notenstein Finance (Guernsey) Ltd, St Peter Port, Guernsey												
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.02.2015	02.02.2017	24 972 007	%	104.14	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.02.2015	27.02.2017	24 972 054	%	107.68	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Pernod Ricard	EUR	1'000.00	28.08.2015	28.02.2017	26 243 451	%	104.85	99.91	100.00		0.000	Y
Protection Participation on IBM	USD	1'000.00	25.02.2016	01.03.2017	31 525 457	%	94.35	94.34	95.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.03.2015	03.03.2017	24 972 064	%	99.21	98.34	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.03.2015	10.03.2017	24 972 070	%	106.79	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.03.2015	10.03.2017	24 972 069	%	106.41	99.80	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.03.2015	24.03.2017	24 972 104	%	108.32	99.82	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.04.2015	10.04.2017	24 972 123	%	108.51	100.00	100.00		0.000	Y
10 1/2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.04.2016	18.04.2017	30 324 653	%	50.11	100.00	100.00		0.000	Y
7 1/4 % Reverse Convertible on Air France - KLM	EUR	1'000.00	25.04.2016	25.04.2017	30 324 710	%	70.34	100.00	100.00		0.000	Y
Protection Participation on Apple	USD	1'000.00	26.04.2016	26.04.2017	31 525 687	%	94.93	94.28	95.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.04.2015	28.04.2017	24 972 129	%	107.82	100.00	100.00		0.000	Y
9 1/2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.04.2016	28.04.2017	31 525 698	%	102.73	100.00	100.00		0.000	Y
11.35 % (15.9 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.08.2016	28.04.2017	32 674 109	%	105.44	100.00	100.00		0.000	Y
Protection Participation on Apple	USD	1'000.00	03.05.2016	03.05.2017	31 525 722	%	94.90	93.85	95.00		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.04.2016	04.05.2017	31 525 702	%	102.43	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.05.2015	08.05.2017	24 972 155	%	102.41	99.88	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.05.2015	08.05.2017	24 972 157	%	102.82	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Swisscom N	EUR	1'000.00	07.03.2016	08.05.2017	30 324 045	%	92.92	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.11.2015	09.05.2017	28 371 658	%	79.50	100.00	100.00		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on OC Oerlikon N	CHF	1'000.00	09.11.2015	09.05.2017	24 972 333	%	101.29	100.00	100.00	05.02.	0.000	N
										06.05.	0.000	
										05.08.	0.000	
										07.11.	0.000	
Reverse Convertible on BMW	EUR	1'000.00	02.05.2016	09.05.2017	30 324 734	%	95.22	100.00	100.00		0.000	Y
15 1/4 % Reverse Convertible on Hertz Global Hldgs	USD	1'000.00	10.05.2016	10.05.2017	31 525 261	%	79.84	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.05.2015	11.05.2017	27 476 295	%	130.21	98.30	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Tesla Motors	EUR	1'000.00	16.02.2016	16.05.2017	30 324 450	%	97.88	100.00	100.00		0.000	Y
Protection Participation on EUR/USD	EUR	1'000.00	16.05.2016	16.05.2017	32 338 966	%	97.07	90.00	90.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Tesla Motors	USD	1'000.00	17.02.2016	17.05.2017	30 324 449	%	96.45	99.13	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Novartis N	CHF	1'000.00	19.02.2016	19.05.2017	31 525 401	%	89.73	100.00	100.00		0.000	Y
Protection Participation on Crude Oil	USD	1'000.00	19.05.2016	19.05.2017	31 525 346	%	101.05	89.33	90.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Zurich Insur GrpN	CHF	205.60	22.02.2016	22.05.2017	31 525 405	CHF	286.35	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Apple	USD	50'000.00	13.05.2016	22.05.2017	30 324 807	%	118.66	99.22	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on The Swatch Grp	CHF	324.00	23.02.2016	23.05.2017	31 525 404	CHF	332.58	99.97	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.11.2015	24.05.2017	27 475 991	%	95.02	98.84	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Technip	CHF	1'000.00	24.02.2016	24.05.2017	31 525 447	%	98.61	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	35.34	19.02.2016	29.05.2017	31 525 406	CHF	49.16	99.97	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Allianz N	EUR	1'000.00	07.03.2016	07.06.2017	30 324 046	%	120.55	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	07.03.2016	07.06.2017	30 324 024	%	105.95	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Diageo	GBP	16.78	10.05.2016	12.06.2017	32 338 816	CHF	22.85	99.14	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	11.12.2015	13.06.2017	30 324 225	%	100.69	99.95	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	14.03.2016	14.06.2017	30 324 104	%	117.83	100.00	100.00		0.000	Y
8.52 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	32 571 101	%	107.42	100.00	100.00		0.000	Y
7.52 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	32 571 100	%	106.41	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	03.07.2015	03.07.2017	24 972 206	%	108.67	99.74	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Walt Disney	USD	1'000.00	19.01.2016	17.07.2017	30 324 275	%	98.46	98.55	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.07.2016	20.07.2017	32 950 787	%	131.89	99.32	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.07.2016	20.07.2017	32 950 790	%	133.14	99.32	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Bouygues	EUR	1'000.00	21.04.2016	21.07.2017	30 324 689	%	100.76	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	24.07.2015	24.07.2017	24 972 222	%	54.65	99.80	100.00		0.000	Y
2.6 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	02.05.2016	02.08.2017	30 324 761	%	98.30		100.00	30.05.	0.000	N
										30.06.	0.000	
										28.07.	0.000	
										30.08.	0.000	
										29.09.	0.000	
										28.10.	0.000	
										30.11.	0.000	
										30.12.	0.000	
Reverse Convertible on K+S N	EUR	18.67	07.06.2016	07.08.2017	32 673 839	CHF	21.44	100.00	100.00		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Alphabet-A	USD	5'000.00	10.08.2016	10.08.2017	32 950 904	%	98.70	100.00	100.00		0.000	Y

**Derivative Finanzinstrumente (Ausland) / Produits financiers
dérivés (Etranger) / Strumenti finanziari derivati (Estero)**
Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a u
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%			
6 1/2 % Reverse Convertible on Alphabet-A	USD	5'000.00	10.08.2016	10.08.2017	32 950 905	%	98.26	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.02.2016	15.08.2017	30 324 423	%	80.30	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	23.02.2015	23.08.2017	24 972 039	%	78.51	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.02.2016	28.08.2017	31 525 469	%	77.85	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Deutsche Bank N	USD	1'000.00	03.03.2016	01.09.2017	31 525 491	%	66.40	98.89	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.03.2016	04.09.2017	31 525 483	%	39.94	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Hennes&Mauritz -B-	EUR	219.40	06.07.2016	05.09.2017	32 673 987	CHF	238.94	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on ams	USD	1'000.00	07.03.2016	07.09.2017	30 324 048	%	98.46	98.81	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	08.09.2015	08.09.2017	28 371 473	%	74.33	98.24	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	EUR	1'000.00	11.09.2015	11.09.2017	28 371 471	%	90.65	99.82	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	17.09.2015	12.09.2017	27 476 320	%	80.15	98.37	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.09.2015	14.09.2017	28 371 463	%	66.51	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Richemont N	CHF	62.40	19.02.2016	19.09.2017	31 525 407	CHF	67.50	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	22.09.2015	29.09.2017	27 476 321	%	59.70	98.31	100.00		0.000	Y
8.4 % (8.423398 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.09.2016	29.09.2017	33 245 870	%	105.45	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Tesla Motors	USD	1'000.00	11.04.2016	11.10.2017	31 525 637	%	108.79	98.78	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Commodities	USD	1'000.00	24.10.2014	24.10.2017	24 972 773	%	44.77	97.09	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Fortescue Metals	AUD	100'000.00	19.10.2016	26.10.2017	34 081 320	%	76.26	98.27	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Sears Holdings	USD	1'000.00	29.04.2016	30.10.2017	31 525 715	%	34.25	98.71	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.06.2016	30.10.2017	32 673 910	%	68.18	98.97	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Hertz Global Hldgs	EUR	1'000.00	02.05.2016	01.11.2017	31 525 720	%	31.15	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTXbnk EUR P	EUR	1'000.00	06.05.2016	06.11.2017	30 324 774	%	104.30	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2015	20.11.2017	30 324 126	%	101.81	98.11	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	20.05.2016	20.11.2017	31 525 335	%	99.31	98.97	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Accor	EUR	1'000.00	07.12.2015	07.12.2017	27 476 032	%	102.24	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	USD	1'000.00	08.12.2015	08.12.2017	27 476 034	%	115.45	98.05	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P GSCI Crd OilER	USD	1'000.00	07.06.2016	08.12.2017	32 571 317	%	103.86	98.59	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	18.12.2015	18.12.2017	27 476 088	%	112.53	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.03.2016	05.04.2018	31 525 581	%	37.01	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.06.2016	02.06.2020	32 338 824	%	71.92	95.11	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	02.06.2016	02.06.2020	32 338 823	%	76.96	95.95	100.00		0.000	Y

**Derivative Finanzinstrumente (Ausland) / Produits financiers
dérivés (Etranger) / Strumenti finanziari derivati (Estero)**

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a u
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF					
Royal Bank of Canada, Toronto, Kanada 0.78 % (9.36 % P.A.) Reverse Convertible Autocallable Notes on a Basket of Shs	USD	1'000.00	17.12.2015	18.12.2017	27 621 083	%	98.74	100.00	100.00	19.01.	0.94359	N
										19.02.	0.87577	
										19.03.	0.79969	
										19.04.	0.84784	
										19.05.	0.84621	
										19.06.	0.8474	
										19.07.	0.84198	
										19.08.	0.84748	
										19.09.	0.86535	
										19.10.	0.84559	
										19.11.	0.89134	
										19.12.	0.87518	
Royal Bank of Canada, London Branch, London, Grossbritannien Memory Phoenix Autocallable Notes VRN on a Basket of Shs S23471	CHF	1'000.00	11.08.2015	11.08.2020	29 135 988	%	76.98	100.00	100.00		0.000	Y

**Derivative Finanzinstrumente (Ausland) / Produits financiers
dérivés (Etranger) / Strumenti finanziari derivati (Estero)**
Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a u
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		
SG Issuer SA, Luxemburg												
8.9972 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.05.2015	29.04.2016	27 793 156		-	100.00	100.00		0.000	Y
Phoenix on Shares-Basket	USD	1'000.00	19.02.2015	21.02.2017	25 951 961	%	90.18	98.18	100.00		0.000	Y
10 1/2 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.05.2016	19.05.2017	32 332 541	%	99.69	100.00	100.00		0.000	Y
Express Certificate on basket of 3 Index	EUR	1'000.00	16.07.2014	17.07.2017	24 562 654	CHF	1'065.81	98.868	100.00		0.000	Y
8.4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.09.2016	01.09.2017	32 737 700	%	99.05	100.00	100.00		0.000	N
5.45 % Barrier Reverse Convertible on Index-Basket	CHF	1'000.00	02.09.2015	04.09.2017	28 346 614	%	98.37	100.00	100.00	04.03.	0.000	N
6 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.10.2016	09.10.2017	32 737 931	%	94.37	100.00	100.00	05.09.	0.000	Y
8.3 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.10.2016	12.10.2017	32 738 135	%	97.12	100.00	100.00		0.000	Y
1 % (4 % P.A.) Callable Barrier Reverse Convertible on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	06.11.2014	06.11.2017	25 273 783	%	98.12	100.00	100.00	08.02.	10.301	N
										06.05.	9.643	
										08.08.	10.301	
										07.11.	9.972	
3 1/8 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.05.2016	13.11.2017	32 332 624	%	94.82	100.00	100.00	15.08.	1.981	N
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.08.2016	29.12.2017	32 333 887	%	94.67	100.00	100.00	14.11.	2.646	Y
Buy on Dips Note on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	28.08.2015	28.08.2018	28 346 428	%	95.52	94.717	100.00		0.000	N
Reverse Convertible on UBS Group N	EUR	1'000.00	20.10.2016	22.10.2018	32 738 326	%	100.28	100.00	100.00		0.000	Y
3/4 % (3 % p.a.) Barrier Reverse Convertible on Index-Basket	CHF	1'000.00	18.12.2014	18.12.2018	25 951 429	%	95.12	100.00	100.00	18.03.	0.200	N
										20.06.	0.200	
										19.09.	0.200	
										19.12.	0.250	

**Derivative Finanzinstrumente (Ausland) / Produits financiers
dérivés (Etranger) / Strumenti finanziari derivati (Estero)**

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante oblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a. u.
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF					
Telecom Italia S.p.A., Mailand, Italien 1 1/8 % Equity-Linked Bonds on Mercato Telematico Azionario Shs	EUR	100'000.00	26.03.2015	26.03.2022	27 633 397	%	97.75		100.00	26.03.	612.14	N
										26.09.	618.13	

**Derivative Finanzinstrumente (Ausland) / Produits financiers
dérivés (Etranger) / Strumenti finanziari derivati (Estero)**

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a u
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%	CHF/%		
UBS AG, Jersey Branch, St Helier, Jersey												
3.8 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	14.07.2015	13.01.2017	28 649 866	%	100.51	100.00	100.00	13.01. 13.04. 13.07. 13.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on BP	GBP	1'000.00	01.06.2015	30.05.2017	28 182 707	%	99.80	98.022	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	15.10.2014	17.10.2017	25 639 144	%	100.92	96.48	100.00		0.000	Y
UBS AG, London Branch, London, Grossbritannien												
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.11.2015	08.05.2017	30 100 055	%	99.94	99.97	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	09.11.2015	09.05.2017	30 155 739	%	99.84	98.97	100.00		0.000	Y
7.9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.11.2015	11.05.2017	30 155 976	%	100.70	100.00	100.00	11.02. 12.05. 11.08. 11.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Floating Rate Barrier Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	03.06.2014	06.06.2017	24 519 307	%	100.00	100.00	100.00	04.03. 06.06. 05.09. 05.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Indices	EUR	5'000.00	02.02.2016	02.08.2017	31 168 591	%	100.84	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	5'000.00	02.02.2016	03.08.2017	31 168 592	%	100.62	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	04.11.2015	06.11.2017	30 100 062	%	99.21	99.92	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.11.2015	20.11.2017	30 214 752	%	94.43	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2015	20.11.2017	30 214 417	%	101.32	98.08	100.00		0.000	Y
11.20 % Reverse Convertible on Barrick Gold	USD	1'000.00	21.11.2016	27.11.2017	34 480 312	%	102.38	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	5'000.00	24.06.2016	26.12.2017	32 889 795	%	98.70	98.84	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	5'000.00	21.12.2016	21.12.2021	34 848 136	%	98.76	90.428	100.00		0.000	Y

**Derivative Finanzinstrumente (Ausland) / Produits financiers
dérivés (Etranger) / Strumenti finanziari derivati (Estero)**

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a u
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%	CHF/%		
Vontobel Financial Products Ltd, Vereinigte Arabische Emirate												
4.6 % Multi Defender Vonti on Commodities	CHF	1'000.00	13.02.2013	15.02.2016	14 150 436		-	100.00	100.00	15.02.	2.400	N
9 3/4 % (9.16 % p.a.) Reverse Convertible on Alcoa	USD	1'000.00	30.11.2015	23.12.2016	30 187 727		-	100.00	100.00	23.12.	10.720	Y
4.4 % (4.38 % p.a.) Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	12.02.2016	13.02.2017	30 939 396	%	100.20	100.00	100.00			Y
(1 1/8 % min.) Floored Floater on 3 month CHF with reference bond	CHF	1'000.00	17.02.2012	17.02.2017	14 149 890	%	100.10	100.00	100.00	17.02.	2.875	N
										17.05.	2.875	
										17.08.	2.875	
										17.11.	2.875	
(no min.) Floater Multi Defender VONTI on Equities	CHF	1'000.00	20.02.2014	20.02.2017	14 151 107	%	99.80	100.00	100.00	22.02.	0.000	N
										20.05.	0.000	
										22.08.	0.000	
										21.11.	0.000	
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	03.06.2016	06.06.2017	32 151 322	CHF	995.00	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	27.10.2016	27.07.2017	34 181 684	CHF	1'068.78	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.08.2016	30.08.2017	33 457 729	CHF	1'056.99	100.00	100.00		0.000	Y
9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.04.2016	18.10.2017	32 149 017	%	99.40		100.00	18.07.	0.000	N
										18.10.	0.000	
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.10.2015	16.10.2018	29 258 000	%	92.60	100.00	100.00	18.01.	0.000	N
										18.04.	0.000	
										18.07.	0.000	
										17.10.	0.000	
3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.10.2015	23.10.2018	29 257 898	%	95.00	100.00	100.00	25.01.	0.000	N
										25.04.	0.000	
										25.07.	0.000	
										24.10.	0.000	
(1.85 % min.) Floored Floater with reference bond	CHF	1'000.00	05.11.2013	05.11.2018	14 150 961	%	102.30	100.00	100.00	05.02.	4.676	N
										06.05.	4.676	
										06.08.	4.625	
										07.11.	4.830	
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.12.2015	04.12.2018	30 187 767	%	88.80	100.00	100.00	04.03.	0.000	N
										06.06.	0.000	
										05.09.	0.000	
										05.12.	0.000	
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.12.2015	04.12.2018	30 187 763	%	88.40	100.00	100.00	04.03.	0.000	N
										06.06.	0.000	
										05.09.	0.000	
										05.12.	0.000	
(1.7 % min.) Floored Floater Credit Linked on Petrobras	CHF	1'000.00	04.02.2014	04.02.2019	14 151 045	%	98.20	100.00	100.00	04.02.	17.283	N
(3.15 % min.) Floored Floater with reference bond floating rate	USD	1'000.00	25.02.2014	25.02.2019	14 151 105	%	98.40	100.00	100.00	25.02.	7.962	N
										25.05.	7.806	
										25.08.	7.789	
										25.11.	8.156	
5.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.03.2015	04.03.2019	24 173 198	%	80.70	100.00	100.00	04.03.	0.000	N
Structured Note on Bonds	CHF	1'000.00	05.11.2014	05.11.2020	24 172 939	%	101.90	100.00	100.00	05.02.	3.159	N
										06.05.	3.159	
										06.08.	3.125	
										07.11.	3.263	

**Derivative Finanzinstrumente (Ausland) / Produits financiers
dérivés (Etranger) / Strumenti finanziari derivati (Estero)**

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a u
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF					
Zuercher Kantonalbank Finance (Guernsey) Ltd, Guernsey												
5 % p.a. Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.10.2014	06.10.2016	21 478 057		-	100.00	100.00	06.04. 06.10.	0.155 0.155	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.10.2014	17.10.2016	21 478 098		-	100.00	100.00	18.04. 17.10.	0.18014 0.18014	N
5.1 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	29.04.2015	28.04.2017	24 244 260	%	101.10	100.00	100.00	28.01. 28.04. 28.07. 28.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
4 1/2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	19.01.2015	19.07.2017	26 337 469	%	101.93	100.00	100.00	20.01. 19.07.	0.000 0.000	N
4 1/2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	27.01.2015	27.07.2017	26 337 406	%	101.83	100.00	100.00	27.01. 27.07.	0.000 0.000	N
5 1/2 % Callable Barrier Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.08.2014	14.08.2017	21 477 976	%	82.45	100.00	100.00	16.02. 15.08.	0.45991 0.45991	N
3.2 % Callable Barrier Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.09.2014	04.09.2017	21 478 011	%	100.91	100.00	100.00	04.03. 05.09.	0.450 0.450	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.11.2016	28.11.2017	33 753 896	%	99.54	98.95	100.00		0.000	Y
4 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.09.2015	07.09.2018	28 440 736	%	88.12	100.00	100.00	07.03. 07.09.	0.000 0.000	N