

Ergänzungsjournal - Journal complémentaire - Giornale complementare

Das Ergänzungsjournal enthält die seit dem 13.01.2017 zusätzlich erfassten Titel
Le journal complémentaire comprend tous les nouveaux titres saisis à partir du 13.01.2017
Il giornale complementare comprende tutti i nuovi titoli registrati a partire dal 13.01.2017

Inhaltsverzeichnis - Table des matières - Indice

Ausland	Derivative Finanzinstrumente	Kombinierte Produkte (H-Z)	
Etranger	Produits financiers dérivés	Produits combinés (H-Z)	
Eestero	Strumenti finanziari derivati	Prodotti combinati (H-Z)	2 - 30

**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/%			
HSBC Bank PLC, London, Grossbritannien												
4 1/4 % (8 1/2 % P.A.) Callable Maxi DI Reverse Notes on a Basket of Shs Senior	EUR	1'000.00	12.03.2014	11.03.2016	23 701 666	-	100.00	100.00	100.00	11.03.	2.415	N
1 1/4 % (5 % P.A.) Early Redemption Worst-Of Kick-in Goal on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	08.06.2015	08.06.2016	27 690 611	-	100.00	100.00	100.00	08.03. 08.06.	0.000	N
(3.4 % min.) Floored Barrier Reverse Convertible Notes FRN on a Basket of Indices Sr	EUR	1'000.00	20.06.2013	20.06.2016	20 829 286	-	100.00	100.00	100.00	21.03.	9.365	N
1 1/2 % (6 % P.A.) Callable Maxi DI Reverse on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	28.10.2015	28.10.2016	29 612 621	-	100.00	100.00	100.00	20.06. 28.01. 28.04. 28.07.	9.347 0.000 0.000 0.000	N
28.7.2016 Vorzeitige Rückzahlung 1 1/2 % (6 % P.A.) Early Redemption Worst-Of Kick-In GOAL on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	21.12.2015	21.12.2016	29 438 509	-	100.00	100.00	100.00	21.03. 21.06. 21.09. 21.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
2 % (8 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.11.2016	22.02.2017	34 030 140	%	100.54	100.00	100.00		0.000	Y
1.975 % (7.9 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.07.2016	04.04.2017	32 179 992	-	100.00	100.00	100.00	05.10.	0.000	N
5.10.2016 Vorzeitige Rückzahlung 1 7/8 % (7 1/2 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.10.2016	10.07.2017	33 015 046	n.v.	100.00	100.00	100.00		0.000	N
2 1/8 % (8 1/2 % p.a.) Reverse Convertible on CS Group N	CHF	1'000.00	17.10.2016	17.10.2017	33 015 105	n.v.	100.00	100.00	100.00		0.000	N
Maxi Autocallable Recovery short DI put VRN on a Basket of Indices Senior	USD	1'000.00	13.03.2015	13.03.2018	26 805 554	%	100.87	96.06	100.00		0.000	Y
Maxi Auto-Callable Leverage Basket Airbag on a Basket of Shs Senior	USD	1'000.00	23.03.2015	23.03.2018	26 805 575	%	118.92	96.042	100.00		0.000	Y
Maxi Autocallable Recovery short DI put VRN on a Basket of Indices Senior	USD	1'000.00	01.04.2015	04.04.2018	26 805 682	%	97.55	96.647	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.10.2016	06.04.2018	33 015 140	%	100.10	98.552	100.00		0.000	Y
Maxi Autocallable Recovery short DI put VRN on a Basket of Indices Sr	EUR	1'000.00	28.04.2015	30.04.2018	27 690 444	%	96.93	99.72	100.00		0.000	Y
Maxi Autocallable Recovery short DI put VRN on a Basket of Shs Senior	USD	1'000.00	30.04.2015	30.04.2018	27 690 418	%	102.96	96.83	100.00		0.000	Y
Maxi Autocallable Recovery short DI put VRN on a Basket of Indices Sr	GBP	1'000.00	10.06.2015	11.06.2018	28 320 278	%	93.49	96.28	100.00		0.000	Y
Early Redemption Worst-Of Kick-In Certificate VRN on a Basket of Indices	USD	1'000.00	02.09.2015	05.09.2018	29 438 204	%	100.35	96.697	100.00		0.000	Y
Autocallable Recovery Short DI put VRN on Societe Generale Shs	EUR	1'000.00	16.10.2015	16.10.2018	29 438 365	%	100.00	99.67	100.00		0.000	Y
Maxi Autocallable Recovery Short 1/ Strike Put VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	04.11.2015	05.11.2018	29 438 410	%	101.13	97.11	100.00		0.000	Y
Maxi Autocallable Recovery short DI put VRN on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	09.11.2015	09.11.2018	29 438 454	%	97.00	99.82	100.00		0.000	Y
Maxi Autocallable Recovery Short 1/ Strike Put VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	14.12.2015	14.12.2018	29 438 530	%	98.08	96.35	100.00		0.000	Y
Autocallable Barrier Reverse Convertible VRN on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	21.01.2016	21.01.2019	30 710 670	%	100.36	100.00	100.00		0.000	Y
Maxi Autocallable Recovery short DI put VRN on a Basket of Indices Senior	USD	1'000.00	27.01.2015	29.01.2019	25 717 348	%	105.14	95.00	100.00		0.000	Y
Maxi Autocallable Recovery short DI put VRN on a Basket of Shs Senior	USD	1'000.00	28.01.2015	29.01.2019	25 717 352	%	106.14	95.14	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.09.2016	29.03.2019	33 015 113	%	98.29	97.423	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	19.10.2016	23.04.2019	34 029 907	%	101.41	97.169	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.10.2016	07.10.2019	33 015 139	%	102.71	100.00	100.00		0.000	Y
Maxi Autocallable Recovery short DI put VRN on a Basket of Indices	USD	1'000.00	13.04.2015	09.04.2020	27 690 341	%	99.31	92.714	100.00		0.000	Y
Autocallable Recovery Short DI put VRN on Bouygues SA Shs Senior	EUR	1'000.00	16.04.2015	16.04.2020	27 690 336	%	100.52	98.718	100.00		0.000	Y
Autocallable Recovery Short DI put VRN on Total SA Shs Senior	EUR	1'000.00	17.06.2015	17.06.2020	28 320 280	%	98.57	97.42	100.00		0.000	Y
Maxi Autocallable Recovery short DI put VRN on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	29.10.2015	29.10.2020	29 438 397	%	98.69	98.35	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 g
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%	CHF/%	CHF/%	
Reverse Convertible on Equities HSBC FRANCE, Paris, Frankreich	USD	1'000.00	26.08.2016	26.08.2021	33 014 929	CHF	1'125.75	94.241	100.00		0.000	Y
Quanto Certificates on a Basket of Shares	USD	1'000.00	01.07.2015	02.07.2018	28 320 377	%	98.59	96.396	100.00		0.000	Y
Index linked Certificate on a Basket of Indices HSBC Trinkaus & Burkhardt AG, Düsseldorf, Deutschland	EUR	1'000.00	02.04.2015	03.04.2020	26 805 658	%	104.77	98.76	100.00		0.000	Y
Discount-Zert. auf SAP	EUR	49.44	22.07.2013	23.01.2015	21 926 907		-	99.350	100.00			Y
3.2 % Protect-Aktienanl. auf Linde	EUR	1'000.00	12.10.2015	11.10.2016	29 701 010		-	100.00	100.00	11.10.	1.370	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					
J.P.Morgan Structured Products B.V., Amsterdam, Niederlande												
6.7 % (13.4 % P.A.) Barrier Reverse Convertible Note on a Bskt of Fund & Index	USD	1'000.00	08.05.2015	06.05.2016	27 431 214		-	100.00	100.00	06.05.	3.552	N
6 % Barrier Reverse Convertible Note on Apple	USD	1'000.00	08.07.2015	10.01.2017	28 073 617		n.v.	100.00	100.00	08.01. 08.04. 08.07. 08.10.	1.866 1.787 1.844 1.843	N
Autocallable Barrier Reverse Convertible Certificate VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	23.04.2015	21.04.2017	27 433 599	%	97.95	100.00	100.00		0.000	Y
4 % Barrier Reverse Convertible on Euro Stoxx 50-Index	CHF	1'000.00	25.06.2014	20.06.2017	22 438 908		n.v.	100.00	100.00	29.06. 29.12.	0.46878 0.46878	N
Phoenix Autocallable Certificates VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	07.04.2015	03.04.2018	18 006 643	%	97.98	96.740	100.00		0.000	Y
Autocallable Barrier Reverse Certificate VRN on a Basket of Indices	USD	1'000.00	07.04.2015	09.04.2018	26 114 311	CHF	953.66	96.765	100.00		0.000	Y
1.37 % (5.48 % p.a.) Reverse Convertible on Novo Nordisk -B-	EUR	1'000.00	07.11.2016	07.05.2018	33 715 382	%	99.92	100.00	100.00		0.000	N
4 % Barrier Reverse Convertible on Euro STOXX 50-Index	EUR	1'000.00	29.10.2015	29.10.2018	28 073 740	%	98.20	100.00	100.00	29.04. 29.10.	0.32934 0.32521	N
Underlying Tracker on Euro Stoxx 50	CHF	1'000.00	14.06.2016	14.06.2019	29 519 469	%	103.06	100.00	100.00	14.09. 14.12.	4.169 3.602	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	CHF	1'000.00	25.04.2016	25.10.2019	29 519 437	CHF	1'055.07	100.00	100.00		0.000	Y
1.05 % Fixed Credit Linked Note Cr Lnk on UBS AG Reference Entity	CHF	10'000.00	27.01.2015	20.03.2020	18 006 536	%	98.60		100.00	21.03.	105.57	N
Express Certificate with Contingent Memory VRN on a Basket of Indices	USD	1'000.00	10.02.2016	10.02.2021	30 631 978	%	106.10	94.119	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities Series 2016-16596	EUR	1'000.00	16.11.2016	16.11.2021	33 715 397	%	101.67	99.293	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/%			
Landesbank Baden-Wuerttemberg, Stuttgart, Deutschland												
5.3 % Easy-Aktienanl. auf N.-Akt. Daimler	EUR	1'000.00	10.01.2014	24.06.2016	23 309 392		-		100.00	24.06.	57.139	N
(3.5 % - 6 %) Bonitaetsanl. mit Kreditrisiko auf ArcelorMittal Staffelzins	EUR	1'000.00	02.10.2015	12.01.2022	29 684 165	%	104.16	100.00	100.00		0.000	N
Leonteq Securities AG, Guernsey Branch, Guernsey												
13.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.10.2014	06.01.2016	24 534 035		-	100.00	100.00	06.01.	0.100	N
5.02 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.10.2014	06.04.2016	24 534 004		-	100.00	100.00	06.04.	0.500	N
5 % Barrier Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	24.10.2013	24.10.2016	22 492 717		-	100.00	100.00	24.10.	3.200	N
3.22 % Reverse Convertible on Commodities	USD	1'000.00	06.05.2015	08.11.2016	26 668 537		-	100.00		08.11.	5.945	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.04.2015	13.04.2017	25 406 457	%	0.38	98.38	100.00		0.000	Y
8 % Barrier Reverse Convertible on Equities	AUD	1'000.00	21.06.2013	21.06.2017	21 385 517	%	101.66	100.00	100.00	21.06.	5.570	N
8.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.11.2016	07.11.2017	31 524 766	%	100.66	100.00	100.00		0.000	N
Reverse Convertible on Basket	CHF	1'000.00	29.12.2014	05.01.2018	24 533 140	%	96.15	99.960	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	CHF	1'000.00	29.12.2014	05.01.2018	24 533 139	%	99.18	99.936	100.00	01.12.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.01.2016	08.01.2018	30 039 671	%	100.62	97.70	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.10.2016	26.01.2018	31 524 753	%	99.77	100.00	100.00		0.000	Y
5.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.02.2016	05.02.2018	30 460 489	%	97.66	100.00	100.00	04.05. 04.08. 03.11.	0.000 0.000 0.000	N
5 % Barrier Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.08.2014	08.02.2018	24 533 727	%	97.67	100.00	100.00	05.02. 09.05. 08.08. 07.11.	0.350 0.350 0.350	N
Reverse Convertible on Pan Amer Silver	USD	1'000.00	06.03.2015	06.03.2018	24 533 152	%	119.74	96.43	100.00		0.000	Y
6.51 % p.a. Barrier Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.09.2012	12.03.2018	19 443 451	%	19.51	97.72	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.12.2016	16.03.2018	31 524 871	%	102.49	98.56	100.00		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	02.05.2013	10.04.2018	18 426 093	%	88.14	95.39	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ConocoPhillips	USD	1'000.00	11.10.2016	11.04.2018	30 460 595	%	101.37	98.58	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.10.2016	18.04.2018	30 460 640	%	95.56	98.46	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
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.11.2016	14.05.2018	31 524 787	%	102.14	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.05.2016	23.05.2018	26 668 990	%	97.91	98.28	100.00		0.000	Y
5.2 % Barrier Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.05.2014	30.05.2018	24 203 734	%	98.97	100.00	100.00	28.02. 28.05. 29.08. 28.11.	0.500 0.500 0.500	N
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.06.2016	25.06.2018	31 875 469	%	72.39	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Mkt Vctr Rus ETFT	USD	1'000.00	19.01.2016	19.07.2018	25 407 128	%	101.26	97.21	100.00		0.000	Y
5 % Barrier Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.08.2014	06.08.2018	24 533 680	%	97.76	100.00	100.00	29.01. 29.04. 29.07. 31.10.	0.450 0.450 0.450	N
Reverse Convertible on Equities	CZK	1'000.00	07.08.2015	07.08.2018	26 668 670	%	81.11	98.78	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.09.2015	17.09.2018	29 348 116	%	64.58	96.66	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Fiat Chrysler Auto	EUR	1'000.00	17.10.2016	03.10.2018	30 460 635	%	99.07	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.11.2015	02.11.2018	25 406 871	%	92.38	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	02.11.2016	02.11.2018	33 705 281	%	101.08	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	29.10.2015	05.11.2018	25 406 858	%	90.25	97.10	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	07.11.2016	07.11.2018	33 705 290	%	100.43	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Volkswagen Vz	USD	1'000.00	07.11.2016	07.11.2018	33 705 291	%	101.91	97.87	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Volkswagen Vz	USD	1'000.00	15.11.2016	15.11.2018	33 705 326	%	102.58	97.89	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	28.11.2016	28.11.2018	33 705 375	%	101.22	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	16.12.2016	17.12.2018	34 820 173	%	99.80	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	21.01.2016	21.01.2019	26 669 160	%	106.76	96.92	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	21.01.2016	21.01.2019	26 669 161	%	107.07	99.97	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.01.2016	22.01.2019	25 407 143	%	106.50	96.60	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/%	CHF/%	
Reverse Convertible on Equities	CZK	1'000.00	05.02.2016	05.02.2019	26 668 941	%	82.26	99.19	100.00		0.000	Y
Express Certificate on Advanced Micro Dev.	EUR	100.00	26.02.2014	26.02.2019	23 486 130	CHF	148.79	95.15	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica	EUR	1'000.00	14.09.2016	27.03.2019	26 669 114	%	92.51	100.00	100.00		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	24.10.2016	24.04.2019	31 524 748	%	97.25	100.00	100.00		0.000	N
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	13.05.2014	13.05.2019	24 203 520	%	97.47	95.38	100.00		0.000	Y
Capital Protection-Cert. on Equities	AUD	1'000.00	13.05.2014	13.05.2019	24 203 557	CHF	807.99	93.98	112.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.05.2016	20.05.2019	26 668 992	%	88.94	97.15	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.07.2016	29.07.2019	31 875 526	%	96.25	97.03	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.07.2016	29.07.2019	31 875 528	%	97.54	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.09.2016	09.09.2019	26 669 098	%	95.49	96.83	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.09.2016	13.09.2019	26 669 109	%	96.59	96.97	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.10.2016	21.10.2019	33 705 208	%	99.72	96.66	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.11.2016	05.11.2019	33 705 255	CHF	999.74	96.73	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	25.10.2016	08.11.2019	31 524 751	%	100.27	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on UniCredit	EUR	1'000.00	10.11.2016	11.11.2019	33 705 289	%	98.76	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	04.12.2015	04.12.2019	26 668 883	%	92.19	95.08	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.12.2015	04.12.2019	26 668 884	%	91.49	94.55	100.00		0.000	Y
Express Certificate on DSM	EUR	100.00	29.01.2014	29.01.2020	22 851 017	CHF	112.45	92.27	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	10.03.2015	10.03.2020	25 406 405	%	92.67	92.64	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	13.03.2015	13.03.2020	26 670 646	%	101.19	92.83	100.00		0.000	Y
Capital Protection Certificate on basket	CHF	100.00	07.05.2014	07.05.2020	24 203 512	CHF	103.00	96.65	100.00		0.000	Y
Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	04.08.2014	04.08.2020	24 533 700	%	85.20	95.45	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	28.08.2015	28.08.2020	25 406 640	%	98.05	98.17	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	31.08.2015	31.08.2020	25 406 645	%	98.03	92.96	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	04.09.2015	04.09.2020	25 406 667	%	96.93	92.28	100.00		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	08.09.2014	08.09.2020	24 533 867	%	113.44	89.01	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	CHF	1'000.00	18.12.2015	18.12.2020	26 669 165	%	90.74	100.00	100.00		0.000	Y
5.67 % Structured Note on NOBLE CORP PLC	USD	1'000.00	20.12.2016	11.01.2021	34 820 192	%	98.91	100.00	100.00		0.000	N
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	29.01.2015	29.01.2021	25 406 350	%	128.55	92.16	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	24.02.2015	24.02.2021	25 406 385	%	120.75	91.24	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	14.04.2015	14.04.2021	25 406 460	%	96.91	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	14.09.2015	24.08.2021	26 668 767	%	102.01	90.78	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.10.2016	25.10.2021	33 705 206	CHF	1'045.74	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	09.11.2015	09.11.2021	26 668 931	%	93.81	90.86	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	21.01.2016	21.01.2022	26 669 158	%	98.51	91.89	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	21.01.2016	21.01.2022	26 669 159	%	99.76	97.87	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	22.01.2016	24.01.2022	30 324 192	%	106.94	90.80	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.12.2016	20.12.2022	31 524 860	%	100.16	89.27	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 CHF/%	Bondkomponente Composante obligat. Composante obblig.		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				
Merrill Lynch International & Co CV, Curacao, Curaçao												
Worst of Barrier Reverse Convertible VRN on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	29.06.2015	25.06.2018	28 651 752	CHF	923.99	100.00	100.00		0.000	Y
Autocallable Certificate on a Basket of Indices	USD	100.00	26.02.2014	26.02.2019	23 733 856		n.v.	92.424	100.00		0.000	Y
Accumulator Autocallable Certificate on a Basket of Indices	USD	100.00	26.02.2015	26.02.2020	27 215 583	CHF	116.09	92.016	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/%	%	%	%	
Natixis Structured Issuance SA, Luxemburg												
Phoenix MO VRN on Societe Generale SA Shs	EUR	1'000.00	16.03.2016	16.03.2018	29 625 576	%	103.34	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.09.2016	24.09.2018	32 071 668	%	99.70	100.00	100.00		0.000	Y
Phoenix Yeti VRN on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	21.01.2016	21.01.2019	29 661 993	%	102.89	100.00	100.00		0.000	Y
Phoenix VRN on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	21.01.2016	21.01.2019	29 661 994	%	103.91	100.00	100.00		0.000	Y
Phoenix MO VRN on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	12.02.2016	12.02.2019	29 662 037	%	102.25	100.00	100.00		0.000	Y
Index Linked Interest Rate and Index Linked Redemption Notes VRN on Euro Stoxx 50 Index S1188	EUR	1'000.00	25.01.2016	27.01.2020	29 661 999	%	101.62	99.565	100.00		0.000	Y
Phoenix Mo VRN on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	29.02.2016	28.02.2020	29 625 563	%	101.32	100.00	100.00		0.000	Y
PHOENIX WO VRN on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	28.12.2015	28.12.2020	30 804 664	%	79.267	98.413	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	29.12.2016	12.01.2023	32 742 459		n.v.	100.00	100.00		0.000	Y
Notenstein Finance (Guernsey) Ltd, St Peter Port, Guernsey												
7.1 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	27.06.2016	27.06.2017	30 050 297		-	100.00	100.00	23.09. 23.12.	0.000 0.000	N
23.12.2016 Vorzeitige Rückzahlung												
8.16 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.08.2015	04.08.2017	28 371 425	%	100.39	100.00	100.00	02.02. 03.05. 02.08. 02.11.	0.27808 0.27436 0.27053 0.26968	N
4.52 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.02.2016	04.08.2017	30 324 350		n.v.	100.00	100.00	02.05. 02.08. 01.11.	0.000 0.000 0.000	N
7.8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.08.2015	11.08.2017	24 972 240		n.v.	100.00	100.00	09.02. 09.08.	4.365 4.420	N
6.05 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	08.09.2015	12.09.2017	26 243 467	%	99.96		100.00	10.03. 09.06. 09.09. 08.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
4.8 % Reverse Convertible on Equities	SEK	1'000.00	15.01.2016	15.01.2018	27 476 149	%	98.65	99.50	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	26.01.2016	26.01.2018	27 476 220	%	101.17	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.01.2015	30.01.2018	26 243 365	%	37.12	99.52	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.08.2016	12.02.2018	32 950 915	%	100.00	98.71	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.02.2015	15.02.2018	26 243 344	%	101.09	96.92	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Peabody Energy	EUR	1'000.00	19.02.2015	19.02.2018	24 972 041	%	4.22	99.46	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	19.02.2015	19.02.2018	24 972 042	%	92.82	99.46	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.02.2016	26.02.2018	31 525 470	%	57.64	98.46	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.02.2016	26.02.2018	31 525 468	%	79.88	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.09.2016	09.03.2018	33 245 667	%	96.70	98.55	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Glencore	GBP	1'000.00	14.03.2016	14.03.2018	30 324 094	%	160.90	98.48	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Rio Tinto Sp ADR	USD	1'000.00	16.03.2016	16.03.2018	31 525 567	%	83.14	98.17	100.00		0.000	Y
4 % Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.03.2015	19.03.2018	26 671 143	%	105.06	100.00	100.00	19.03.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.09.2016	20.03.2018	33 245 737	%	94.64	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.09.2016	20.03.2018	33 245 736	%	94.98	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Tesla Motors	USD	1'000.00	20.09.2016	20.03.2018	33 705 920	%	100.80	98.53	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.09.2016	26.03.2018	33 245 798	%	98.22	98.55	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Nickel	USD	1'000.00	30.03.2016	03.04.2018	31 525 620	%	107.43	98.10	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.04.2016	18.04.2018	31 525 652	%	82.98	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on BMW	EUR	1'000.00	25.04.2016	25.04.2018	30 324 704	%	101.97	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur GrpN	CHF	1'000.00	02.05.2016	02.05.2018	31 525 700	%	148.75	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.11.2016	02.05.2018	33 705 823	%	101.66	98.50	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.05.2015	08.05.2018	27 476 291	%	114.16	96.85	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Airbus Group	EUR	1'000.00	09.05.2016	09.05.2018	31 525 736	%	111.08	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	14.11.2016	14.05.2018	33 705 880	%	103.56	98.53	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	16.11.2015	16.05.2018	27 475 959	%	97.69	97.54	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Porsche AutoHldgVz	EUR	1'000.00	17.05.2016	17.05.2018	31 525 303	%	100.25	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P GSCI Crd OilER	USD	1'000.00	23.05.2016	23.05.2018	31 525 693	%	105.19	98.30	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Siemens N	EUR	1'000.00	23.05.2016	23.05.2018	31 525 332	%	124.16	100.00	100.00		0.000	Y
6.5 % Reverse Convertible on Adecco Group N	CHF	1'000.00	23.05.2016	23.05.2018	31 525 323		n.v.	100.00	100.00	18.11.	0.000	N
Underlying Tracker on CS Group N	EUR	1'000.00	24.05.2016	24.05.2018	31 525 373	%	116.40	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.05.2016	31.05.2018	32 338 762	%	101.37	98.05	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.06.2016	01.06.2018	31 452 359	%	69.74	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/%				
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	1'000.00	08.12.2016	08.06.2018	34 081 137	%	106.34	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	15.06.2016	15.06.2018	32 673 887	%	48.90	98.17	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	03.07.2015	03.07.2018	27 476 314	%	90.03	95.80	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	07.07.2015	09.07.2018	28 371 401	%	95.41	99.37	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Brazil	USD	1'000.00	11.07.2016	11.07.2018	32 950 788	%	109.08	98.54	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on CAC 40	EUR	1'000.00	13.01.2016	13.07.2018	27 476 158	%	100.62	100.00	100.00		0.000	Y
1/2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.02.2016	08.08.2018	30 324 367	%	85.75	98.14	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Allianz N	EUR	1'000.00	08.08.2016	10.08.2018	32 950 911	%	127.68	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.02.2016	15.08.2018	30 324 425	%	12.32	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.02.2016	15.08.2018	30 324 424	%	49.18	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur GrpN	EUR	1'000.00	16.08.2016	16.08.2018	32 950 928	%	115.44	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.02.2016	20.08.2018	31 525 400	%	98.49	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Seagate Technology	EUR	1'000.00	18.08.2016	31.08.2018	32 674 123	%	135.61	100.00	100.00		0.000	Y
8.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	31.08.2016	31.08.2018	32 951 035	%	85.39	100.00	100.00	30.11.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.08.2016	06.09.2018	32 951 047	%	96.94	98.03	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	31.08.2016	07.09.2018	32 571 256	%	97.72	98.05	100.00		0.000	Y
6.44 % Reverse Convertible on Equities	EUR	100.00	07.09.2016	07.09.2018	33 245 854	%	99.26		100.00	01.12.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.09.2015	17.09.2018	26 243 506	%	124.00	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.09.2016	17.09.2018	33 245 720	%	95.58	98.04	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	18.03.2016	18.09.2018	30 324 505	%	98.56	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.10.2015	01.10.2018	28 371 563	%	45.99	99.67	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.10.2015	01.10.2018	28 371 564	%	44.60	96.89	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.09.2015	02.10.2018	28 371 533	%	100.31	96.91	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.10.2016	11.10.2018	34 081 314	%	98.06	98.05	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.10.2016	12.10.2018	33 705 749	%	110.99	97.97	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on USD/BRL	USD	1'000.00	20.10.2015	22.10.2018	28 371 614	%	134.46	97.14	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.04.2016	29.10.2018	31 525 669	%	91.26	97.76	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	29.04.2016	29.10.2018	31 525 718	%	95.90	97.54	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.05.2016	05.11.2018	31 525 726	%	94.21	97.49	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.11.2016	21.11.2018	34 081 389	%	107.51	97.57	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.11.2016	23.11.2018	33 706 042	%	95.53	97.59	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.11.2015	30.11.2018	28 371 675	%	95.19	96.46	100.00	29.11.	0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	23.05.2016	30.11.2018	32 338 970	%	106.40	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.12.2016	05.12.2018	34 081 111	%	100.51	97.45	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	06.12.2016	06.12.2018	34 081 118	%	105.81	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	18.12.2015	18.12.2018	27 476 086	%	102.46	96.34	100.00		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	24.12.2015	24.12.2018	27 476 118	%	107.30	93.34	97.11		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	18.01.2016	18.01.2019	27 476 177	%	108.78	99.97	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.07.2016	21.01.2019	32 674 049	%	101.54	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Total	EUR	1'000.00	08.02.2016	08.02.2019	30 323 871		n.v.	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on UniCredit	EUR	1'000.00	25.05.2016	14.02.2019	31 525 383	%	97.67	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Accor	EUR	1'000.00	19.02.2016	19.02.2019	30 323 953	%	102.98	100.00	100.00		0.000	Y
10 1/2 % (3.41 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.01.2016	28.02.2019	30 324 320	%	92.02	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	29.02.2016	28.02.2019	30 323 965	%	101.28	97.55	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	09.03.2016	11.03.2019	31 525 521	%	107.84	97.02	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.03.2016	14.03.2019	31 525 544	%	56.05	97.02	100.00		0.000	Y
11 % (3.57 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.03.2016	01.04.2019	31 451 870	%	94.20	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.04.2016	08.04.2019	31 525 632	%	72.85	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	EUR	1'000.00	02.11.2016	02.05.2019	33 705 825	%	97.21	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2015	20.05.2019	30 323 819	%	109.88	95.42	100.00		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	18.05.2016	20.05.2019	32 338 985	%	98.29	91.34	94.00		0.000	Y
Reverse Convertible on IBEX 35	EUR	1'000.00	19.05.2016	21.05.2019	31 525 287	%	98.64	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Partners Grp Hldg N	CHF	1'000.00	27.05.2016	27.05.2019	32 338 756	%	116.39	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.06.2016	20.06.2019	32 571 063	%	98.19	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Silber 1 Uz	USD	1'000.00	28.10.2016	29.07.2019	33 705 826	%	98.30	97.06	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	02.09.2016	02.09.2019	33 245 847	%	99.43	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	09.09.2016	09.09.2019	33 245 640	%	100.54	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	09.09.2016	09.09.2019	33 245 642	%	100.04	96.83	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTXbnk EUR P	EUR	100.00	10.03.2016	10.09.2019	31 525 530	CHF	98.59	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	12.09.2016	12.09.2019	33 245 669	%	78.59	96.80	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	18.09.2015	18.09.2019	26 243 493	%	101.51	98.97	100.00		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	31.10.2014	31.10.2019	24 971 906	%	98.98	92.14	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.11.2016	11.11.2019	33 705 873	%	102.26	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.11.2014	18.11.2019	24 972 793	%	12.22	97.78	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/%				
8.00 % (2.66 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.11.2016	18.11.2019	34 081 371	%	100.06	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on STXE6O&G EUR P	EUR	1'000.00	30.12.2014	30.12.2019	24 971 979	%	110.98	98.02	100.00		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	27.01.2015	27.01.2020	26 243 347	%	107.75	93.01	100.00		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	04.02.2015	04.02.2020	26 243 381	%	95.30	93.49	95.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	03.02.2015	07.02.2020	26 243 366	%	94.33	93.92	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	02.03.2015	20.02.2020	26 243 371	%	100.29	93.24	100.00			Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	23.03.2015	23.03.2020	27 476 231	%	101.11	92.52	101.00		0.000	Y
Underlying Tracker on MSCI WORLD INDEX	USD	1'000.00	25.03.2015	25.03.2020	26 243 426	%	87.37	91.92	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	30.03.2016	30.03.2020	30 324 585	%	95.76	95.23	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	USD	1'000.00	21.04.2015	21.04.2020	24 972 130	%	79.22	92.96	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Brazil	USD	1'000.00	29.05.2015	28.05.2020	27 476 307	%	94.61	91.92	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.06.2016	18.06.2020	32 339 048	%	70.37	95.14	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.06.2016	06.07.2020	32 571 300	%	66.42	95.55	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	02.11.2016	02.11.2020	33 705 814	%	99.75	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.12.2015	04.12.2020	28 371 677	%	95.76	99.20	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.12.2015	08.12.2020	30 324 205	%	97.54	92.78	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.01.2016	25.01.2021	27 476 144	%	98.75	98.51	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.02.2015	02.02.2021	24 972 009	%	76.55	97.66	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	10.02.2016	03.02.2021	30 324 358	%	95.69	99.36	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	04.02.2016	04.02.2021	30 323 859	%	104.03	93.47	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P 500	USD	1'000.00	04.02.2016	04.02.2021	30 323 860	%	104.29	93.51	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible 2016-16.02.21 on Indices	USD	1'000.00	22.02.2016	16.02.2021	30 324 413	%	99.62	94.23	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.03.2016	09.03.2021	30 324 077	%	105.99	99.95	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.03.2016	15.03.2021	31 525 555	%	106.88	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.03.2016	15.03.2021	31 525 556	%	97.87	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	22.03.2016	22.03.2021	31 525 585	%	100.93	93.33	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	24.03.2016	24.03.2021	31 525 607	%	99.08	93.79	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	12.04.2016	13.04.2021	31 525 626	%	104.12	94.16	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	13.04.2016	13.04.2021	30 324 639	%	112.06	94.44	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	19.04.2016	19.04.2021	31 524 542	%	95.98	94.72	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on IBEX 35	USD	1'000.00	28.04.2015	28.04.2021	27 476 282	%	71.26	90.75	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.04.2016	29.04.2021	31 525 712	%	93.53	99.75	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTXbnk EUR P	EUR	1'000.00	03.05.2016	03.05.2021	30 050 273	%	94.52	99.75	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	03.05.2016	03.05.2021	30 324 770	%	100.51	93.65	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	04.05.2016	04.05.2021	27 476 347	%	95.01	94.49	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2021	30 324 779	%	99.60	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	05.05.2016	05.05.2021	31 525 684	%	90.63	93.98	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	SGD	1'000.00	01.06.2016	01.06.2021	27 476 356	%	100.47	90.22	100.00		0.000	Y
Protection Participation on Silber 1 Uz	USD	1'000.00	07.06.2016	07.06.2021	32 338 865	%	96.95	93.70	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.06.2016	16.06.2021	32 673 889	%	97.51	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	15.07.2016	15.07.2021	32 673 946	%	101.97	97.20	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.07.2016	19.07.2021	32 674 047	%	99.06	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on EUR/USD	USD	1'000.00	27.07.2016	20.07.2021	32 674 081	%	102.59	95.02	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.07.2016	26.07.2021	32 674 045	%	92.20	95.05	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	15.09.2015	15.09.2021	26 243 477	%	85.18	96.47	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.09.2016	28.09.2021	33 705 946	%	92.82	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	05.11.2015	05.11.2021	27 475 946	%	94.77	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	15.11.2016	15.11.2021	33 705 966	%	101.82	100.00	100.00		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	19.11.2015	19.11.2021	28 371 683	%	97.26	91.08	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	19.11.2015	19.11.2021	27 475 980	%	98.66	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	26.11.2015	26.11.2021	27 476 009	%	92.85	100.00	100.00		0.000	N
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.11.2015	30.11.2021	30 324 157	%	86.70	98.98	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	10.12.2015	10.12.2021	27 476 047	%	93.70	100.00	100.00		0.000	Y
135 % Barrier Reverse Convertible on reg.shs Banco Santander	EUR	1'000.00	15.12.2015	15.12.2021	27 476 045	%	97.65	97.12	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	28.12.2015	28.12.2021	27 476 093	%	97.73	97.75	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	14.01.2016	14.01.2022	27 476 168	%	108.81	97.63	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	15.02.2016	15.02.2022	30 324 377	%	109.49	98.81	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	12.04.2016	12.04.2022	30 324 626	%	104.09	92.54	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	12.04.2016	12.04.2022	30 324 596	%	96.42	99.28	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	14.04.2016	14.04.2022	31 525 646	%	115.51	99.46	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	22.04.2016	22.04.2022	31 525 636	%	95.46	93.59	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	19.05.2016	19.05.2022	31 525 659	%	97.07	92.82	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.05.2016	23.05.2022	31 525 334	%	85.10	99.40	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/%	%	%	%	
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	06.06.2016	06.06.2022	32 571 278	%	94.00	92.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.06.2016	08.06.2022	32 338 906	%	93.86	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	15.06.2016	15.06.2022	32 571 243	%	98.84	92.71	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	16.08.2016	16.08.2022	32 674 096	%	96.44	97.17	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.09.2016	14.09.2022	33 245 708	%	88.01	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	19.09.2016	26.09.2022	33 245 699	%	98.71	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	16.11.2016	14.11.2022	34 081 367	%	96.89	94.94	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.11.2016	16.11.2022	33 705 981	%	93.11	99.22	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	25.11.2016	25.11.2022	34 081 040	%	100.36	90.11	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.11.2016	30.11.2022	34 081 045	%	101.04	98.45	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.12.2016	08.12.2022	34 081 138	%	97.34	98.63	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.12.2016	08.12.2022	34 081 139	%	96.48	89.11	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/%	CHF/%		
Raiffeisen Switzerland B.V., Amsterdam, Niederlande													
8.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.09.2016	16.03.2018	33 245 723	%	94.01	100.00	100.00				N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.10.2016	24.04.2018	34 081 337	%	101.37	98.53	100.00		0.000		Y
8.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	31.05.2016	31.05.2018	32 338 794	%	98.16	100.00	100.00	29.08. 29.11.	0.000 0.000		N
3.25 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	19.09.2016	19.09.2018	33 245 842	%	97.31	100.00	100.00		0.000		N
Reverse Convertible on Airbus Group	EUR	1'000.00	14.12.2016	19.12.2018	33 875 350	%	100.47	100.00	100.00		0.000		Y
Reverse Convertible on AbbVie	USD	1'000.00	14.12.2016	19.12.2018	33 875 351	%	99.19	97.37	100.00		0.000		Y
Reverse Convertible on Bankia SA	EUR	1'000.00	19.12.2016	19.12.2018	33 875 347	%	98.91	100.00	100.00		0.000		Y
Reverse Convertible on Easyjet	EUR	1'000.00	15.07.2016	31.12.2018	32 674 026	%	98.18	100.00	100.00		0.000		Y
Reverse Convertible on UniCredit	EUR	1'000.00	19.05.2016	11.02.2019	31 525 349	%	98.29	100.00	100.00		0.000		Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.03.2016	11.03.2019	31 525 463	%	103.84	100.00	100.00	11.06. 11.09. 11.12.	0.000 0.000 0.000		N
Reverse Convertible on Telefonica	EUR	1'000.00	20.04.2016	27.04.2021	30 324 680	%	95.54	99.85	100.00		0.000		Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	09.11.2016	09.11.2021	33 705 871	%	100.54	93.79	100.00		0.000		Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	28.12.2016	28.12.2022	33 875 438	%	98.84	98.69	100.00		0.000		Y
1.7 % Structured Note Credit Linked on LAFARGEHOLCIM LTD	CHF	1'000.00	29.02.2016	12.01.2023	30 324 453	%	104.87	100.00	100.00		0.000		N
Royal Bank of Canada, Toronto, Kanada													
1 1/2 % (6 % P.A.) Barrier Reverse Convertible Notes on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	04.08.2014	02.08.2016	23 752 664		-	100.00	100.00	04.02. 04.05. 02.08.	0.15875 0.15875 0.15522		N
Notes on RBC GELP (UK) Ltd Ref Entity (1 % min./4 % max.) Collared Floating Rate Notes Floating Rate Series 17628	GBP	1'000.00	14.04.2015	10.04.2019	25 280 588	%	107.35	94.40	100.00		0.000		Y
	USD	1'000.00	12.09.2014	12.09.2019	24 782 632		n.v.	100.00	100.00	12.03. 12.06. 12.09. 12.12.	2.491 2.468 2.488 2.568		N
Phoenix Autocallable Notes VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	27.03.2015	27.03.2020	25 280 598	%	86.66	92.185	100.00		0.000		Y
Phoenix Autocallable Notes VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	27.03.2015	27.03.2020	25 280 597	%	86.84	99.999	100.00		0.000		Y
Royal Bank of Canada, London Branch, London, Grossbritannien													
5.1 % Callable Barrier Reverse Convertible Notes on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	03.06.2015	02.12.2016	27 811 783		-	100.00	100.00	03.03. 03.06. 05.09. 02.12.	0.000 0.000 0.000 0.000		N
Memory Phoenix Autocallable Notes VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	11.06.2015	12.06.2017	27 433 601	%	83.12	100.00	100.00		0.000		Y
1.76 % (7.04 % P.A.) Barrier Reverse Convertible Notes on a Basket of Index	USD	1'000.00	06.02.2015	07.08.2017	25 280 636		n.v.	100.00	100.00	08.02. 06.05. 08.08. 07.11.	2.319 2.127 2.304 2.217		N
1 5/8 % (6 1/2 % P.A.) Barrier Reverse Convertible Notes on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	30.07.2015	30.01.2018	27 620 378	%	65.31	100.00	100.00	01.02. 04.05. 02.08. 31.10.	0.000 0.000 0.000 0.000		N
Memory Phoenix Autocallable Notes VRN on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	02.03.2015	02.03.2018	25 280 725	%	99.29	99.529	100.00		0.000		Y
6.4 % (pro rata) Reverse Convertible on Basket	CHF	1'000.00	10.06.2016	11.06.2018	27 620 772		n.v.	100.00	100.00	12.09. 12.12.	0.000 0.000		N
Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	53.35	29.12.2016	29.06.2018	34 491 206		n.v.	100.00	100.00		0.000		Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.08.2015	01.09.2020	27 620 715	%	76.15	92.181	100.00		0.000		Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.08.2015	01.09.2020	29 432 079		n.v.	92.181	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'em. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%			
SG Issuer SA, Luxemburg 15.48 % Phoenix on Shares-Basket	USD	1'000.00	06.05.2015	03.03.2016	27 793 137	-	100.00	100.00	29.01. 03.03.	0.51231 0.4964	N	
8 1/2 % Barrier Reverse Convertible on Shares-Basket	CHF	1'000.00	17.08.2015	17.08.2016	28 346 441	-	100.00	100.00	17.02.	0.000	N	
6.48 % Barrier Reverse Convertible on Index-Basket	CHF	1'000.00	31.08.2015	31.08.2016	28 346 558	-	100.00	100.00	17.08. 29.02.	0.000 0.000	N	
1.625 % Phoenix on Shares-Basket	CHF	1'000.00	08.04.2015	07.10.2016	25 952 353	-	100.00	100.00	31.05. 31.08. 07.01.	0.000 0.000 0.000	N	
10.69 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.05.2016	22.12.2016	32 332 666	-	100.00	100.00	06.04. 07.07. 07.10.	0.000 0.000 0.000	Y	
7.89 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.06.2016	28.12.2016	32 333 126	-	100.00	100.00	22.12.	5.990	Y	
17 1/4 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.06.2016	30.12.2016	32 332 853	-	100.00	100.00	28.12.	4.980	Y	
13.57 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.04.2016	05.04.2017	28 348 177	%	101.07	100.00	30.12.	6.070	Y	
4.109 % Barrier Reverse Convertible on Shares-Basket	CHF	1'000.00	18.09.2015	28.04.2017	28 346 733	%	97.19	100.00		0.000	Y	
5.83 % (pro rata) Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	09.06.2016	28.04.2017	32 332 989	n.v.		100.00		0.000	Y	
1 1/4 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.06.2016	08.06.2017	32 332 694	%	97.53	100.00	08.09.	0.000	N	
Recovery Note on RWE	EUR	1'000.00	17.12.2015	19.06.2017	28 347 439	%	64.03	100.00	08.12.	0.000	Y	
4.963 % Barrier Reverse Convertible on Shares-Basket	EUR	1'000.00	11.12.2015	23.06.2017	28 347 399	n.v.		100.00		0.000	Y	
7.05 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	25.05.2016	26.06.2017	32 332 801	%	105.50	100.00		0.000	Y	
4.07 % Barrier Reverse Convertible on Shares-Basket	CHF	1'000.00	25.08.2015	25.08.2017	28 346 536	%	72.75	100.00		0.000	Y	
1 1/4 % (5 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.10.2016	06.10.2017	32 737 904	%	98.38	100.00		0.000	N	
(no min.) Credit Linked Note Credit linked on Akbank floating rate	USD	10'000.00	22.08.2014	10.10.2017	24 562 732	%	105.05	96.599		0.000	Y	
2.4 % Phoenix on Index-Basket	CHF	1'000.00	18.11.2015	27.11.2017	28 347 166	n.v.		100.00	18.02. 19.05. 18.08. 18.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N	
0.654 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.12.2016	08.12.2017	34 886 811	%	100.51	100.00		0.000	N	
1.25 % (5 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.12.2016	22.12.2017	32 738 877	n.v.		100.00		0.000	N	
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	26.10.2016	19.01.2018	32 738 303	%	100.00	100.00		0.000	Y	
Reverse Convertible on Shares-Basket	USD	1'000.00	31.07.2015	31.01.2018	28 273 183	%	91.79	97.298		0.000	Y	
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.09.2016	08.03.2018	32 737 765	%	93.43	100.00		0.000	Y	
11.25 % (7.5 % p.a.) Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	16.09.2016	16.03.2018	32 737 773	%	99.24	100.00		0.000	Y	
Reverse Convertible on Richemont N	CHF	1'000.00	05.10.2016	05.04.2018	32 737 996	%	112.64	100.00		0.000	Y	
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.10.2016	16.04.2018	32 738 259	%	91.87	100.00		0.000	Y	
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.10.2016	23.04.2018	32 738 358	%	101.03	100.00		0.000	Y	
5/8 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.05.2016	08.05.2018	28 348 336	%	97.19	100.00	08.08.	0.000	N	
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.11.2016	24.05.2018	32 738 789	%	100.51	100.00	08.11.	0.000	Y	
8 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.12.2016	18.06.2018	34 398 870	%	102.05	100.00		0.000	Y	
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	03.08.2016	03.08.2018	32 333 652	%	102.08	100.00		0.000	Y	
Express-Cert. on Index-Basket	CHF	1'000.00	20.08.2015	20.08.2018	28 346 497	%	102.77	100.00		0.000	Y	
Phoenix Plus on Index-Basket	CHF	1'000.00	20.08.2015	24.08.2018	28 346 492	%	96.13	100.00		0.000	Y	
(no min.) Kick-In GOAL on CAC 40-Index floating rate	EUR	1'000.00	04.09.2015	04.09.2018	28 346 575	%	97.16	99.551		0.000	Y	
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	23.09.2016	24.09.2018	32 737 944	%	100.38	99.114		0.000	Y	
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.09.2016	24.09.2018	32 737 847	%	99.58	100.00		0.000	Y	
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.09.2016	24.09.2018	32 737 943	%	97.08	97.971		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/%	%	%	%	
2 % Barrier Reverse Convertible on Index-Basket	CHF	1'000.00	13.04.2015	15.10.2018	25 952 394	%	95.17	100.00	100.00	13.04.	0.000	N
										13.10.	0.000	
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	20.10.2016	22.10.2018	32 738 332	%	99.51	97.893	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Deutsche Bank N	EUR	1'000.00	24.10.2016	24.10.2018	33 119 668	%	103.80	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.10.2016	29.10.2018	32 738 333	%	99.97	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.10.2016	29.10.2018	32 738 331	%	100.19	97.87	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.10.2016	29.10.2018	32 738 334	%	99.95	100.00	100.00		0.000	Y
4 1/2 % Barrier Reverse Convertible on Index-Basket	EUR	1'000.00	31.10.2014	31.10.2018	25 307 677	%	95.99	100.00	100.00	02.02.	1.001	N
										02.05.	1.001	
										01.08.	0.96167	
										31.10.	0.97564	
Phoenix Plus called for Red. on 09.05.16 at 100 %	USD	1'000.00	06.11.2014	06.11.2018	25 307 729		-	94.003	100.00		0.000	Y
9.5.2016 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.638%												
Underlying Tracker on Equities	NOK	1'000.00	04.11.2016	07.11.2018	33 119 690	%	108.18	97.622	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.11.2016	15.11.2018	32 738 660	%	97.80	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	24.11.2016	26.11.2018	32 738 799	%	99.76	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Total	CHF	1'000.00	24.11.2016	26.11.2018	32 738 798	%	100.36	100.00	100.00		0.000	Y
Phoenix on Index-Basket	CHF	1'000.00	01.12.2015	03.12.2018	28 347 271	%	94.80	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.12.2016	17.12.2018	34 398 860	%	104.27	97.37	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	19.12.2016	19.12.2018	32 738 945	%	98.88	100.00	100.00		0.000	Y
4.27 % CLN Credit Linked on a Basket of Refrence Entities	EUR	1'000.00	18.02.2014	10.01.2019	23 673 326	%	107.51	100.00	100.00	10.01.	10.919	N
4 % Credit Linked Notes Credit Linked on RALLYE	CHF	1'000.00	04.11.2015	10.01.2019	28 346 997	%	99.16	100.00	100.00	11.01.	7.330	N
										11.07.	20.000	
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.09.2016	07.03.2019	32 737 753	%	96.42	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on equities	USD	1'000.00	22.08.2016	22.08.2019	32 333 857	%	86.43	96.957	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	31.08.2016	02.09.2019	32 737 686	%	98.93	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.09.2016	16.09.2019	32 737 787	%	98.30	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.09.2016	19.09.2019	32 737 857	%	92.23	96.766	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.09.2016	23.09.2019	33 119 614	%	92.50	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	23.09.2016	23.09.2019	33 119 617	%	98.40	96.689	100.00		0.000	Y
(2.45 % min.) Credit Linked Notes Credit Linked to Portugal Telecom Intl Finance	CHF	1'000.00	18.08.2014	10.10.2019	24 562 813		n.v.	100.00	100.00	11.01.	4.360	N
										11.04.	4.292	
										11.07.	4.351	
										10.10.	6.193	
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.10.2016	21.10.2019	32 738 351	%	80.72	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.10.2016	25.10.2019	33 119 669	%	100.15	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.10.2016	28.10.2019	33 119 671	%	100.37	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.10.2016	31.10.2019	32 738 487	%	103.54	96.63	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.11.2016	04.11.2019	32 738 511	%	89.31	99.499	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.12.2016	02.12.2019	33 119 725	%	99.63	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.12.2016	02.12.2019	33 119 729	%	100.42	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.12.2016	06.12.2019	32 738 880	%	101.00	95.585	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.12.2016	09.12.2019	33 119 737	%	99.48	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.12.2016	09.12.2019	33 119 738	%	99.24	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse convertible on Equities	USD	1'000.00	12.12.2016	13.12.2019	33 119 744	%	100.31	95.585	100.00		0.000	Y
(3.825 % min.) Notes on Basket	USD	1'000.00	14.05.2015	07.05.2020	27 793 221	%	95.90	92.244	100.00		0.000	Y
3 % Credit Linked Notes Credit Linked on Bombardier	CHF	1'000.00	29.04.2015	10.07.2020	27 793 066	%	98.62	100.00	100.00	11.07.	35.916	N
(4.15 % Max.) Credit Linked Note Cr. Lkd. on CDX High Yield S24 floating rate	CHF	1'000.00	23.06.2015	10.07.2020	28 272 737	%	96.16		100.00	11.01.	10.259	N
										11.04.	10.375	
										11.07.	10.375	
										10.10.	10.259	
(no min.) Zero Recovery Credit Linked Notes FRN on iTraxx Europe Series 23 Ref Ent	USD	10'000.00	10.08.2015	10.07.2020	28 436 232	%	91.02	100.00	100.00	10.07.	489.92	N
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 14.3.2016 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	11.09.2015	11.09.2020	28 346 646	%	-	97.975	100.00		0.000	Y
Phoenix Plus on Index-Basket	CHF	1'000.00	20.07.2015	20.07.2021	28 273 054	%	95.45	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.09.2016	30.09.2021	32 737 928	%	55.64	100.00	100.00	30.12.		N
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.12.2016	09.12.2021	32 738 926	%	93.87	100.00	100.00		0.000	Y
2.7 % Credit Linked Notes Credit Linked on iTraxx Main S22	CHF	1'000.00	09.03.2015	10.01.2022	25 952 038	%	82.24	100.00	100.00	09.03.	26.550	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
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%				
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.03.2016	22.03.2022	28 348 035	%	86.00	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	22.09.2016	22.09.2022	32 737 913	%	98.62	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	29.09.2016	13.10.2022	32 738 011	%	100.28	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	07.10.2016	21.10.2022	32 738 158	%	99.98	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	16.11.2016	30.11.2022	32 738 601	%	100.32	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	16.11.2016	30.11.2022	32 738 599	%	101.34	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on SG	GBP	1'000.00	14.12.2016	30.11.2022	33 119 740	%	98.16	100.00	100.00			N
Notes on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	14.05.2015	15.05.2023	28 267 022	%	96.28	94.72	100.00		0.000	Y
Dual Range Accrual Callable Note VRN on a Basket of Libor & Index	USD	1'000.00	20.03.2014	20.03.2029	23 957 093	%	102.62	61.165	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/%			
UBS AG, Jersey Branch, St Helier, Jersey												
(3 1/4 % min. - 5 % max.) Floating rate	NOK	1'000.00	06.01.2012	06.01.2016	13 998 126	-	-	100.00	100.00	06.01.	0.93357	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	14.07.2015	16.07.2018	28 727 051	%	101.17	96.341	100.00		0.000	Y
Kick-In Certificate on Indices	USD	1'000.00	13.08.2014	14.08.2018	25 087 140	%	99.43	94.22	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.09.2014	24.09.2018	25 420 708	%	99.52	93.774	100.00	26.09.	34.824	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	02.10.2014	02.10.2018	25 490 481	%	99.00	93.442	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	02.10.2014	02.10.2018	25 490 482	%	99.48	92.68	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	13.01.2015	14.01.2019	26 526 053	%	101.39	94.52	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	30.01.2015	30.01.2019	26 718 517	%	100.62	95.227	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	30.01.2015	30.01.2019	26 718 519	%	100.98	95.567	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	17.02.2016	18.02.2019	31 383 592	%	106.31	97.41	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on STXE6BaR EUR P	USD	1'000.00	22.07.2015	22.07.2019	28 916 368	CHF	1'060.14	94.11	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	22.09.2014	23.09.2019	25 451 057	%	123.09	91.02	100.00		0.000	Y
UBS AG, London Branch, London, Grossbritannien												
7 % Reverse Convertible on Syngenta N	CHF	5'000.00	23.12.2014	23.06.2015	26 391 741	-	-	100.00	100.00			N
16.14 % Reverse Convertible on Galenica N	CHF	5'000.00	03.03.2015	01.07.2015	24 612 576	-	-	100.00	100.00			N
9.61 % Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	10.03.2015	10.08.2015	27 222 662	-	-	100.00	100.00			N
13.33 % Reverse Convertible on Clariant N	CHF	1'000.00	09.06.2015	09.09.2015	28 338 281	-	-	100.00	100.00			N
6.46 % Reverse Convertible on ams	CHF	1'000.00	17.03.2015	17.09.2015	27 271 340	-	-	100.00	100.00			N
9.05 % Reverse Convertible on OC Oerlikon N	CHF	1'000.00	02.07.2015	02.11.2015	28 581 364	-	-	100.00	100.00			N
11 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.11.2014	26.11.2015	25 942 726	-	-	100.00	100.00			N
6.85 % Reverse Convertible on Sunrise Comm	CHF	1'000.00	11.08.2015	11.12.2015	29 046 350	-	-	100.00	100.00			N
10.04 % Reverse Convertible on u-blox Hldg N	CHF	1'000.00	11.08.2015	11.01.2016	28 987 069	-	-	100.00	100.00	11.01.	0.01673	N
8.74 % Reverse Convertible on Aryszt N	CHF	1'000.00	24.08.2015	25.01.2016	29 184 981	-	-	100.00	100.00	25.01.	0.01699	N
7.96 % Reverse Convertible on Aryszt N	CHF	1'000.00	27.08.2015	27.01.2016	29 184 843	-	-	100.00	100.00	27.01.	0.0167	N
8.28 % Reverse Convertible on Logitech Intl N	CHF	1'000.00	27.08.2015	27.01.2016	29 184 845	-	-	100.00	100.00	27.01.	0.01672	N
10.18 % Reverse Convertible on u-blox Hldg N	CHF	1'000.00	27.08.2015	27.01.2016	29 184 848	-	-	100.00	100.00	27.01.	0.01669	N
7 1/4 % Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	27.08.2015	27.01.2016	29 184 842	-	-	100.00	100.00	27.01.	0.01668	N
10.02 % Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	29.09.2015	29.01.2016	29 656 465	-	-	100.00	100.00	29.01.	0.00848	N
10.06 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	30.09.2015	01.02.2016	29 657 051	-	-	100.00	100.00	01.02.	0.00904	N
14.69 % Reverse Convertible on ams	CHF	1'000.00	02.09.2015	02.02.2016	29 256 562	-	-	100.00	100.00	02.02.	0.01698	N
10.01 % Reverse Convertible on Galenica N	CHF	10'000.00	02.09.2015	02.02.2016	29 321 539	-	-	100.00	100.00	02.02.	0.16988	N
9.26 % Reverse Convertible on Richemont N	CHF	1'000.00	03.09.2015	03.02.2016	29 321 725	-	-	100.00	100.00	03.02.	0.017	N
6.97 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.08.2015	04.02.2016	28 942 428	-	-	100.00	100.00	04.02.	1.181	N
6.58 % Reverse Convertible on Sika	CHF	10'000.00	04.08.2015	04.02.2016	28 986 034	-	-	100.00	100.00	04.02.	0.25205	N
9.27 % Reverse Convertible on Roche Hldg G	CHF	5'000.00	10.09.2015	10.02.2016	29 403 301	-	-	100.00	100.00	10.02.	0.08495	N
5.6 % Reverse Convertible on Novartis N	CHF	1'000.00	10.09.2015	10.02.2016	29 402 954	-	-	100.00	100.00	10.02.	0.01696	N
7.13 % Reverse Convertible on Roche Hldg G	CHF	5'000.00	10.09.2015	10.02.2016	29 402 959	-	-	100.00	100.00	10.02.	0.08492	N
9.11 % Reverse Convertible on Novartis N	CHF	1'000.00	10.09.2015	10.02.2016	29 403 328	-	-	100.00	100.00	10.02.	0.01695	N
8.66 % Reverse Convertible on Julius Baer Grp N	CHF	1'000.00	11.09.2015	11.02.2016	29 403 026	-	-	100.00	100.00	11.02.	0.01697	N
3.69 % Reverse Convertible on Equities	EUR	5'000.00	16.02.2015	12.02.2016	27 055 492	-	-	100.00	100.00	12.02.	6.194	N
7.31 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.08.2015	15.02.2016	29 046 543	-	-	100.00	100.00	15.02.	0.02578	N
7.65 % Reverse Convertible on Novartis N	CHF	1'000.00	09.10.2015	19.02.2016	29 800 114	-	-	100.00	100.00	11.01.	0.02575	N
										19.02.	0.01065	

**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/%			
5 % Reverse Convertible on Novartis N	CHF	1'000.00	21.09.2015	22.02.2016	29 579 296	-	100.00	100.00	22.02.	0.0173	N	
13.23 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	13.08.2015	29.02.2016	29 046 548	-	100.00	100.00	15.02.	0.25479	N	
6.59 % Reverse Convertible on Richemont N	CHF	1'000.00	03.11.2015	07.03.2016	30 100 308	-	100.00	100.00	29.02.	0.01916	N	
12.04 % Reverse Convertible on ams	CHF	1'000.00	05.11.2015	07.03.2016	30 155 636	-	100.00	100.00	03.02.	0.02518	N	
7.98 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	08.12.2015	08.03.2016	30 453 785	-	100.00	100.00	07.03.	0.00902	N	
9.04 % Reverse Convertible on Sunrise Comm	CHF	1'000.00	09.11.2015	09.03.2016	30 155 754	-	100.00	100.00	05.02.	0.0252	N	
6.55 % Reverse Convertible on Novartis N	CHF	1'000.00	18.09.2015	18.03.2016	29 508 002	-	100.00	100.00	07.03.	0.00851	N	
4.51 % Reverse Convertible on Richemont N	CHF	1'000.00	23.09.2015	23.03.2016	29 579 608	-	100.00	100.00	08.02.	0.01697	N	
9.72 % Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	23.09.2015	23.03.2016	29 579 519	-	100.00	100.00	08.03.	0.00795	N	
11.14 % Reverse Convertible on Novartis N	CHF	1'000.00	23.09.2015	23.03.2016	29 579 605	-	100.00	100.00	09.02.	0.02522	N	
6.57 % Reverse Convertible on Novartis N	CHF	1'000.00	23.09.2015	23.03.2016	29 579 604	-	100.00	100.00	09.03.	0.00796	N	
2.3 % Reverse Convertible on Novartis N	CHF	1'000.00	23.09.2015	23.03.2016	29 579 607	-	100.00	100.00	18.03.	0.02496	N	
9.14 % Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	26.10.2015	30.03.2016	30 012 407	-	100.00	100.00	23.03.	0.02494	N	
8.57 % Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	27.10.2015	30.03.2016	30 100 001	-	100.00	100.00	23.03.	0.02491	N	
11 3/4 % Reverse Convertible on Galenica N	CHF	10'000.00	04.12.2015	04.04.2016	30 453 516	-	100.00	100.00	23.03.	0.02496	N	
8.52 % Reverse Convertible on Autoneum N	CHF	1'000.00	20.11.2015	20.04.2016	30 297 776	-	100.00	100.00	23.03.	0.025	N	
7.56 % Reverse Convertible on BB Biotech N	CHF	5'000.00	26.11.2015	26.04.2016	30 382 685	-	100.00	100.00	23.03.	0.02521	N	
9.09 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	15.02.2016	17.05.2016	31 321 043	-	100.00	100.00	30.03.	0.01756	N	
10.85 % Reverse Convertible on Syngenta N	CHF	5'000.00	17.12.2015	18.05.2016	30 627 446	-	100.00	100.00	27.01.	0.0252	N	
10 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.05.2015	30.05.2016	28 004 167	-	100.00	100.00	30.03.	0.01726	N	
8.54 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	02.11.2015	02.06.2016	30 100 199	-	100.00	100.00	04.03.	0.24931	N	
7 1/4 % Reverse Convertible on Partners Grp Hldg N	CHF	5'000.00	06.11.2015	06.06.2016	30 155 700	-	100.00	100.00	04.04.	0.08493	N	
8.94 % Reverse Convertible on Syngenta N	CHF	5'000.00	10.12.2015	10.06.2016	30 537 226	-	100.00	100.00	22.02.	0.02576	N	
6.54 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	28.12.2015	27.06.2016	30 701 747	-	100.00	100.00	20.04.	0.0159	N	
8.91 % Reverse Convertible on OC Oerlikon N	CHF	1'000.00	30.11.2015	30.06.2016	30 382 874	-	100.00	100.00	26.02.	0.12605	N	
6.67 % Reverse Convertible on DKSH Hldg N	CHF	1'000.00	06.11.2015	06.07.2016	30 155 699	-	100.00	100.00	26.04.	0.0822	N	
8 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	28.01.2016	28.07.2016	31 095 390	-	100.00	100.00	15.04.	0.08219	N	
									17.05.	0.04383	N	
									17.03.	0.12465	N	
									18.05.	0.08493	N	
									29.02.	0.16233	N	
									30.05.	0.16578	N	
									02.05.	0.04988	N	
									02.06.	0.00848	N	
									06.05.	0.24931	N	
									06.06.	0.04248	N	
									10.03.	0.12466	N	
									10.06.	0.126	N	
									29.03.	0.12599	N	
									27.06.	0.12331	N	
									30.05.	0.04988	N	
									30.06.	0.00847	N	
									06.05.	0.04985	N	
									06.07.	0.01671	N	
									28.04.	0.02493	N	
									28.07.	0.02493	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
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%	CHF/%	CHF/%	
10.76 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	04.09.2015	05.09.2016	29 321 847		-	100.00	100.00	04.03.	0.2493	N
6.66 % Reverse Convertible on UBS Group N	CHF	1'000.00	04.09.2015	05.09.2016	29 321 849		-	100.00	100.00	05.09. 04.03.	0.25343 0.04984	N
5.63 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	04.09.2015	05.09.2016	29 321 845		-	100.00	100.00	05.09. 04.03.	0.05067 0.24928	N
7.93 % Reverse Convertible on UBS Group N	CHF	1'000.00	03.06.2016	06.09.2016	32 622 304		-	100.00	100.00	05.09. 03.08.	0.25346 0.0167	N
12.15 % Reverse Convertible on Galenica N	CHF	10'000.00	03.06.2016	06.09.2016	32 622 298		-	100.00	100.00	06.09. 03.08.	0.00933 0.16711	N
7.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.09.2015	14.09.2016	29 507 320		-	100.00	100.00	06.09. 14.03. 14.09.	0.09316 0.000 0.000	N
8.05 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.08.2015	07.11.2016	28 986 239		-	100.00	100.00	05.02. 09.05. 08.08. 07.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
4.54 % Reverse Convertible on Deutsche TelekomN	EUR	1'000.00	10.11.2015	09.11.2016	30 155 867		-	100.00	100.00	10.05. 09.11.	0.49793 0.48498	N
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.05.2015	15.11.2016	28 111 767		-	100.00	100.00	18.05. 15.11.	0.10027 0.04958	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.11.2015	18.11.2016	30 099 967		-	100.00	100.00	18.05. 18.11.	0.000 0.000	N
4.9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	24.12.2015	27.12.2016	30 701 662		-	100.00	100.00	24.06. 27.12.	0.25071 0.25479	N
4.77 % Reverse Convertible on Aryzta N	CHF	1'000.00	19.07.2016	19.01.2017	33 184 749		n.v.	100.00	100.00	19.10.	0.02515	N
Autocallable Notes on S&P GSCI CRD OIL ER Indices	EUR	1'000.00	24.07.2015	25.01.2017	27 988 624		n.v.	99.875	100.00		0.000	Y
8.43 % Reverse Convertible on Forbo Hldg N	CHF	5'000.00	25.08.2016	25.01.2017	33 572 726		n.v.	100.00	100.00	25.11.	0.12603	N
8.72 % Reverse Convertible on Rieter Hldg N	CHF	1'000.00	25.08.2016	25.01.2017	33 572 729		n.v.	100.00	100.00	25.11.	0.02522	N
7.4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	28.01.2016	30.01.2017	31 095 509		n.v.	100.00	100.00	28.07.	0.04986	N
5.08 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.02.2015	01.02.2017	27 164 382		n.v.	100.00	100.00	24.02.	1.414	N
8.38 % Reverse Convertible on Autoneum N	CHF	5'000.00	01.09.2016	01.02.2017	33 623 583		n.v.	100.00	100.00	01.12.	0.12464	N
8.38 % Reverse Convertible on u-blox Hldg N	CHF	1'000.00	01.09.2016	01.02.2017	33 623 579		n.v.	100.00	100.00	01.12.	0.02494	N
8.38 % Reverse Convertible on u-blox Hldg N	CHF	1'000.00	01.09.2016	01.02.2017	33 623 578		n.v.	100.00	100.00	01.12.	0.02494	N
9.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.02.2015	10.02.2017	26 996 423	%	94.80	100.00	100.00	10.02. 11.05. 10.08. 10.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
8.27 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	22.02.2016	22.02.2017	31 371 004		n.v.	100.00	100.00	22.08.	0.24933	N
11.33 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	23.11.2016	27.02.2017	34 553 738		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
13.14 % Reverse Convertible on Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	23.11.2016	27.02.2017	34 553 737		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5 1/2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	23.03.2015	23.03.2017	27 404 617		-	100.00	100.00	23.03. 23.06. 23.09. 23.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
23.12.2016 Vorzeitige Rückzahlung 6 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.09.2015	23.03.2017	29 321 425	%	76.75	100.00	100.00	23.03. 23.06. 23.09. 23.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
12.92 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	22.04.2016	24.04.2017	32 160 632		n.v.	100.00	100.00	24.10.	30.702	N
3.95 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.05.2016	22.05.2017	32 470 541	%	100.84	100.00	100.00	23.11.	0.05037	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
			Em.preis prix d'em. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%			
6.04 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	30.05.2016	31.05.2017	32 581 906		n.v.	100.00	100.00	30.11.	0.25206	N
Kick-In Certificate on Indices	USD	1'000.00	10.06.2014	19.06.2017	24 519 124	%	90.89	97.23	100.00		0.000	Y
9.2 % Reverse Convertible called for Red. on 27.12.16 at 100%	CHF	1'000.00	29.12.2015	26.06.2017	30 701 770		-	100.00	100.00	29.03.	0.000	N
										27.06.	0.000	
										26.09.	0.000	
										27.12.	0.000	
27.12.2016 Vorzeitige Rückzahlung												
10 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.07.2016	04.07.2017	32 791 323		n.v.	100.00	100.00	04.10.	0.000	N
7 % Reverse Convertible on Deutsche Telekom N	EUR	1'000.00	08.12.2016	10.07.2017	34 706 594		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7.61 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	20.07.2016	20.07.2017	33 184 425	%	103.29	100.00	100.00		0.000	N
6.45 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.07.2016	24.07.2017	33 242 108		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.07.2015	31.07.2017	28 726 560	%	90.10	100.00	100.00	29.01.	0.000	N
										29.07.	0.000	
6.44 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	12.09.2016	12.09.2017	33 721 943		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
10.86 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.09.2016	22.09.2017	33 840 727		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
9.01 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	29.09.2016	29.09.2017	33 958 560		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
Reverse Convertible on Commodities	USD	1'000.00	14.10.2016	16.10.2017	34 118 168	%	96.75	98.439	100.00		0.000	Y
9.09 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.10.2016	19.10.2017	34 175 245		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
13.16 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.10.2016	19.10.2017	34 175 225		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.6 % Reverse Convertible on Deutsche TelekomN	EUR	1'000.00	11.11.2016	13.11.2017	34 371 111		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
9 % Reverse Convertible on Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	29.11.2016	29.11.2017	34 370 625		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.94 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	17.06.2016	04.01.2018	32 790 828		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6.64 % Reverse Convertible on Unicredit	EUR	1'000.00	15.01.2016	15.01.2018	30 875 107		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7.07 % Reverse Convertible on Vodafone Group	GBP	1'000.00	09.09.2016	15.01.2018	33 721 916		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
Reverse Convertible 2015-16.01.18 on Indices	EUR	1'000.00	15.01.2016	16.01.2018	30 781 329	%	102.80	100.00	100.00		0.000	Y
5.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	16.06.2016	16.01.2018	32 791 169		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
11.84 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.01.2016	18.01.2018	30 968 493		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
12.9 % Reverse Convertible on Barrick Gold	USD	1'000.00	21.01.2016	22.01.2018	30 968 598		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.07.2016	29.01.2018	33 242 196		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
13 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.12.2016	29.01.2018	34 922 125		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
13 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.12.2016	29.01.2018	34 922 126		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	30.12.2016	29.01.2018	34 922 120		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7.7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	10.02.2016	02.02.2018	31 321 143		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
2.7 % Reverse Convertible on Novartis N	CHF	1'000.00	05.02.2016	05.02.2018	31 258 339		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.8 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	08.02.2016	08.02.2018	31 258 446		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.02.2016	09.02.2018	31 258 873		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6.38 % Reverse Convertible on Mondelez Int-A	USD	1'000.00	21.12.2016	14.02.2018	34 848 410		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7.08 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	15.02.2016	15.02.2018	31 321 415		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
3.88 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	16.02.2016	16.02.2018	31 370 654		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5.09 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	17.02.2016	16.02.2018	31 370 442		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.05 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	17.02.2016	16.02.2018	31 370 441		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.18 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	22.08.2016	16.02.2018	33 482 742		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7.62 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.10.2016	19.02.2018	34 175 187		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.82 % Reverse Convertible on Novartis N	CHF	1'000.00	01.03.2016	27.02.2018	31 541 505		n.v.	100.00	100.00		0.000	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. 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/%			
9.17 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	01.03.2016	27.02.2018	31 541 508		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.18 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	21.03.2016	27.02.2018	31 822 689		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
3.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	01.04.2016	27.02.2018	31 878 697		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7.79 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	25.04.2016	27.02.2018	32 160 714		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5.53 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	14.03.2016	28.02.2018	31 752 723		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
11.35 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.06.2016	28.02.2018	32 941 547		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
8.13 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	28.07.2016	28.02.2018	33 291 902		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7.93 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	02.11.2016	28.02.2018	34 332 774		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	28.11.2016	28.02.2018	34 480 128	%	101.11	97.50	100.00		0.000	Y
17.53 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.03.2016	01.03.2018	31 878 638		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
10.48 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	23.05.2016	01.03.2018	32 537 844		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	5'000.00	30.12.2016	01.03.2018	34 922 129		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
9.56 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	07.06.2016	02.03.2018	32 671 587		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
2.83 % Reverse Convertible on dorma +kaba Hldg N	CHF	5'000.00	01.07.2016	02.03.2018	32 972 625		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7.01 % Reverse Convertible on BP	GBP	1'000.00	01.09.2016	05.03.2018	33 623 287		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	02.09.2016	05.03.2018	33 686 409	%	99.42	98.55	100.00		0.000	Y
6.65 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	07.03.2016	07.03.2018	31 629 425		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
8.38 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	21.03.2016	08.03.2018	31 822 582		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6.9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	30.03.2016	08.03.2018	31 878 220		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	31.03.2016	08.03.2018	31 878 367		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
3.07 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	01.04.2016	08.03.2018	31 878 699		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
8.38 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	21.03.2016	21.03.2018	31 822 583		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
9.04 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.03.2016	21.03.2018	31 822 580		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7.75 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.04.2016	26.03.2018	32 160 713		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
8.3 % Reverse Convertible on Axa	EUR	1'000.00	30.03.2016	28.03.2018	31 878 275		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6.11 % Reverse Convertible on SAFRAN	EUR	1'000.00	30.03.2016	28.03.2018	31 878 276		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
2.55 % Reverse Convertible on Straumann Hldg N	CHF	5'000.00	28.12.2016	28.03.2018	34 921 932		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	31.03.2016	29.03.2018	31 878 402		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
3.85 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	31.03.2016	29.03.2018	31 878 400		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7.84 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	11.08.2016	29.03.2018	33 401 782		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
9.39 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.09.2016	29.03.2018	33 840 597		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.63 % Reverse Convertible on Swiss Life Hldg N	CHF	5'000.00	11.07.2016	04.04.2018	33 057 090		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
2 % Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	CHF	1'000.00	09.04.2015	09.04.2018	27 359 195	%	98.05	100.00	100.00	09.01.	0.000	N
										09.04. 09.07. 09.10.	0.000 0.000 0.000	
3 1/2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	10.04.2015	10.04.2018	27 703 592	%	96.32		100.00	11.04. 10.10.	0.000 0.000	N
5.72 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	21.04.2016	10.04.2018	32 160 925		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6.02 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	28.04.2016	10.04.2018	32 230 441		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
8.43 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.10.2016	10.04.2018	34 062 320		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7.67 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	11.04.2016	11.04.2018	31 994 075		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6.16 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.10.2016	19.04.2018	34 175 202		n.v.	100.00	100.00		0.000	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
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	%	%	%	
12.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.10.2016	26.04.2018	34 062 383		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7 % Reverse Convertible on Daimler N	EUR	1'000.00	27.06.2016	27.04.2018	32 889 587		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
11 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.05.2016	07.05.2018	32 298 157		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
10.85 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.05.2016	07.05.2018	32 298 302		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	06.05.2015	08.05.2018	27 944 839	%	96.99	99.999	100.00		0.000	Y
5.78 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	08.11.2016	08.05.2018	34 370 659		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
9.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	11.11.2016	08.05.2018	34 426 621		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.05.2016	11.05.2018	32 298 283	%	100.15	98.12	100.00		0.000	Y
3.06 % Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	11.05.2016	14.05.2018	32 414 249		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
3.85 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	18.05.2016	17.05.2018	32 414 763		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7.05 % Reverse Convertible on Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	20.05.2016	18.05.2018	32 537 926		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	24.05.2016	25.05.2018	32 537 720		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7 % Reverse Convertible on Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	30.05.2016	30.05.2018	32 581 697		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.51 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.11.2016	30.05.2018	34 554 067		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
Reverse Convertible on Alibaba Grp Sp ADS	USD	1'000.00	29.11.2016	30.05.2018	34 639 700	%	96.10	98.28	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	71.03	06.02.2015	31.05.2018	26 936 747	CHF	75.78	99.97	100.00		0.000	Y
5.15 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	03.06.2016	04.06.2018	32 622 297		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
8.62 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	04.11.2016	04.06.2018	34 333 305		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	05.12.2016	05.06.2018	34 706 806		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	05.12.2016	05.06.2018	34 706 803		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
9.33 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	10.06.2016	08.06.2018	32 741 021		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6.98 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.12.2016	08.06.2018	34 706 639		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
9.44 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	08.12.2016	08.06.2018	34 706 631		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
8.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	12.12.2016	12.06.2018	34 770 431		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5.79 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.06.2016	13.06.2018	32 741 328		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
1.57 % Reverse Convertible on SMI	CHF	1'000.00	14.06.2016	14.06.2018	32 741 048		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5.41 % Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	14.06.2016	14.06.2018	32 741 403		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7.86 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.12.2016	14.06.2018	34 770 266		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5.53 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	15.12.2016	15.06.2018	34 770 319		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5.02 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	16.12.2016	15.06.2018	34 770 596		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6.26 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	16.12.2016	15.06.2018	34 770 592		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
10.07 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.12.2016	18.06.2018	34 770 584		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.96 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	16.12.2016	18.06.2018	34 848 194		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6.23 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.12.2016	19.06.2018	34 848 282		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	20.12.2016	20.06.2018	34 848 026		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6.51 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	20.12.2016	20.06.2018	34 848 000		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6.06 % Reverse Convertible on Sunrise Comm	CHF	1'000.00	21.12.2016	21.06.2018	34 848 398		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
1.15 % Reverse Convertible on SMI	CHF	1'000.00	22.06.2016	22.06.2018	32 836 763		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
8.76 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	29.12.2016	29.06.2018	34 922 079		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.31 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.12.2016	03.07.2018	34 921 845		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.06 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	29.12.2016	05.07.2018	34 922 053		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.06 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	29.12.2016	05.07.2018	34 922 055		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6.48 % Reverse Convertible on Airbus Group	EUR	1'000.00	30.12.2016	06.07.2018	34 922 130		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	08.07.2015	09.07.2018	28 476 565	%	96.43	100.00	100.00	08.01. 08.04. 08.07. 10.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	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
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	%	%	%	
2.09 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	18.07.2016	18.07.2018	33 103 996		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.58 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.07.2016	19.07.2018	33 184 756		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	22.07.2016	20.07.2018	33 184 887		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5.03 % Reverse Convertible on Swiss Life Hldg N	CHF	5'000.00	25.07.2016	25.07.2018	33 241 800		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.78 % Reverse Convertible on Givaudan N	CHF	10'000.00	02.11.2016	26.07.2018	34 332 828		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6.04 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.08.2016	02.08.2018	33 483 002		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.28 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.08.2016	13.08.2018	33 401 982	%	91.65	100.00	100.00		0.000	N
3.19 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	17.08.2016	17.08.2018	33 482 930		n.v.		100.00		0.000	N
3.83 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.08.2016	24.08.2018	33 572 317		n.v.	100.00	100.00			N
6.81 % Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	03.11.2016	27.08.2018	34 332 893		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6.25 % Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	13.10.2016	31.08.2018	34 118 018		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
8.87 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	10.10.2016	04.09.2018	34 062 318		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	16.09.2016	14.09.2018	33 775 695		n.v.	100.00	100.00			N
3.5 % Reverse Convertible on Swisscom N	CHF	5'000.00	20.09.2016	20.09.2018	33 840 618		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.8 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	22.09.2015	24.09.2018	29 507 870	%	96.81	100.00	100.00	22.03. 22.09.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.09.2015	24.09.2018	29 507 876	%	99.52	96.71	100.00		0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	27.09.2016	27.09.2018	33 902 820		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5.83 % Reverse Convertible on Rieter Hldg N	CHF	1'000.00	03.11.2016	27.09.2018	34 332 889		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	01.10.2015	28.09.2018	29 656 839	%	97.05	100.00	100.00	29.03. 29.06. 29.09. 29.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
3.88 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	28.09.2016	28.09.2018	33 958 827		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	28.09.2016	28.09.2018	33 958 617		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7.33 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	28.09.2016	28.09.2018	33 958 585		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7.19 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	29.09.2016	28.09.2018	33 958 532		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	29.09.2016	28.09.2018	33 958 441		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	29.09.2016	28.09.2018	33 958 450		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4 % Reverse Convertible on Koninklijke KPN NV	EUR	1'000.00	04.10.2016	04.10.2018	34 012 648		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	07.10.2015	05.10.2018	29 579 279	%	103.65		100.00			N
7.16 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	06.10.2016	05.10.2018	34 013 056		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	06.10.2016	05.10.2018	34 013 042		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
7.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.10.2016	05.10.2018	34 062 218		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	07.10.2016	05.10.2018	34 062 239		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
8.46 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	12.10.2016	12.10.2018	34 117 976		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	13.10.2016	12.10.2018	34 117 993		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5.88 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.11.2016	16.10.2018	34 332 881		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	17.10.2016	17.10.2018	34 118 367		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5.96 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.10.2016	19.10.2018	34 175 195		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5.98 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.10.2016	19.10.2018	34 175 244		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5 % Reverse Convertible on Koninklijke KPN NV	EUR	1'000.00	20.10.2016	19.10.2018	34 175 318		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5.73 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	21.10.2016	19.10.2018	34 217 622		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
8.71 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.10.2016	25.10.2018	34 217 801		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	26.10.2016	26.10.2018	34 218 034	%	101.15	97.93	100.00		0.000	Y
6.77 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	26.10.2016	26.10.2018	34 217 979		n.v.	100.00	100.00		0.000	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. 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/%	CHF/%		
10.7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.10.2016	26.10.2018	34 284 095		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
8.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	28.10.2016	26.10.2018	34 284 442		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
Underlying Tracker on ESTXSD30 EUR P	EUR	1'000.00	30.04.2015	30.10.2018	27 640 915	CHF	1'048.89	99.55	100.00		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	31.10.2016	31.10.2018	34 284 170		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	31.10.2016	31.10.2018	34 284 208		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
3.5 % Reverse Convertible on Kuehne +Nagel IntN	CHF	1'000.00	01.11.2016	01.11.2018	34 333 114		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5.93 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	01.11.2016	01.11.2018	34 333 050		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.3 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	07.05.2015	05.11.2018	27 944 916	%	95.22	100.00	100.00	06.05. 04.11.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	11.05.2015	05.11.2018	27 945 163	%	94.90	95.563	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Richemont N	CHF	77.05	06.02.2015	06.11.2018	26 936 756	CHF	67.80	99.96	100.00		0.000	Y
7.27 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.11.2016	07.11.2018	34 370 948		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5.6 % Reverse Convertible on Nike -B-	USD	1'000.00	12.12.2016	07.11.2018	34 707 007		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.11.2015	19.11.2018	30 099 968	%	87.80	100.00	100.00	18.02. 18.05. 18.08. 18.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
2.76 % Reverse Convertible on VAT Group N	CHF	1'000.00	24.11.2016	22.11.2018	34 553 797	%	100.70	100.00	100.00		0.000	Y
6.75 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.11.2016	28.11.2018	34 554 078		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	29.11.2016	29.11.2018	34 640 039		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	30.11.2016	30.11.2018	34 639 829		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	02.12.2016	30.11.2018	34 639 996		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
3.32 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	02.12.2016	30.11.2018	34 640 160		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	05.12.2016	05.12.2018	34 640 216		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6 % Reverse Convertible on Koninklijke KPN NV	EUR	1'000.00	05.12.2016	05.12.2018	34 640 217		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	05.12.2016	05.12.2018	34 640 215		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6.76 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	06.12.2016	06.12.2018	34 706 470		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	08.12.2016	07.12.2018	34 706 660		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	68.18	15.12.2016	17.12.2018	34 770 340	CHF	71.22	99.98	100.00		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	19.12.2016	19.12.2018	34 847 968		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	21.12.2016	21.12.2018	34 848 084		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
6.2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	28.12.2015	27.12.2018	30 701 752		-	100.00	100.00	27.06. 27.12.	0.000 0.000	N
27.12.2016 Vorzeitige Rückzahlung												
4.75 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	31.12.2015	31.12.2018	30 537 437	%	92.45	100.00	100.00	31.03. 30.06. 30.09. 31.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	29.12.2016	31.12.2018	34 848 397	%	99.27	97.03	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	29.12.2016	02.01.2019	34 848 396	%	99.34	100.00	100.00		0.000	Y
Kick-In Certificate on Equities	CHF	1'000.00	21.01.2014	22.01.2019	23 301 009	%	99.85	96.72	100.00		0.000	Y
Phoenix Autocallable on Silber	EUR	1'000.00	22.01.2016	22.01.2019	30 168 108	%	104.28	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	24.02.2015	19.02.2019	27 055 626	%	97.24	99.001	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	24.02.2015	19.02.2019	27 108 316	%	96.44	99.994	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.02.2015	20.02.2019	27 055 625	%	96.49	94.263	100.00		0.000	Y
Kick-In-Cert. auf DAX	EUR	1'000.00	18.03.2016	18.03.2019	30 974 760	%	101.88	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	CHF	1'000.00	25.04.2016	29.04.2019	31 935 935	CHF	1'068.91	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	25.04.2016	29.04.2019	31 935 936	CHF	1'025.11	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	14.07.2015	15.07.2019	28 727 052	%	98.75	99.999	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.07.2015	29.07.2019	28 830 141	%	93.01	94.20	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	5'000.00	11.08.2015	05.08.2019	28 942 438	%	94.67	98.418	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.08.2016	26.08.2019	33 572 844	%	98.85	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	05.10.2016	07.10.2019	34 013 015	%	100.19	96.91	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	03.11.2016	04.11.2019	34 332 959	%	95.99	97.90	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	22.11.2016	22.11.2019	34 554 126	%	90.54	95.91	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	CAD	1'000.00	28.01.2015	28.01.2020	26 778 478	%	103.38	93.98	100.00	22.12.	34.595	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	24.02.2015	25.02.2020	27 164 271	%	98.32	98.506	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	01.08.2016	03.08.2020	33 241 829	%	101.02	95.98	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	5'000.00	10.08.2015	10.08.2020	28 987 044	%	95.45	92.562	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	28.09.2016	30.09.2020	33 902 788	%	99.74	95.48	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/%			
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	06.10.2015	06.10.2020	29 717 775	%	101.96	93.28	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	5'000.00	21.10.2016	21.10.2020	34 118 136	%	98.13	95.29	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	5'000.00	05.05.2016	05.05.2021	32 357 172	%	96.07	93.93	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	5'000.00	02.08.2016	02.08.2021	33 292 197	%	98.25	94.303	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	5'000.00	22.08.2016	23.08.2021	33 482 782	%	97.10	94.433	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	5'000.00	20.10.2016	20.10.2021	34 175 716	%	100.69	93.93	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	05.11.2015	09.11.2021	30 155 766	%	99.42	97.46	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	27.11.2015	26.11.2021	30 382 700	%	97.72	98.16	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	5'000.00	30.11.2016	30.11.2021	34 640 076	%	100.01	91.74	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.10.2016	24.10.2022	34 217 479	%	102.18	92.35	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	24.10.2016	24.10.2022	34 217 480	%	101.93	95.20	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	27.10.2016	27.10.2022	34 284 132	%	100.98	99.80	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	16.11.2016	16.11.2022	34 427 015	%	101.52	100.00	100.00		0.000	Y
UniCredit Bank AG, München, Deutschland												
5.4 % HVB Aktienanl. auf N.-Akt. BASF	EUR	1'000.00	01.03.2016	22.06.2017	31 732 400		n.v.	100.00	100.00		0.000	Y
4.7 % HVB Aktienanl. auf N.-Akt. Deutsche Telekom	EUR	1'000.00	01.03.2016	22.06.2017	31 732 545		n.v.	100.00	100.00		0.000	Y
4.8 % HVB Aktienanl. auf LVMH	EUR	1'000.00	01.03.2016	22.06.2017	31 728 009	%	101.21	100.00	100.00		0.000	Y
4.3 % Protect-Aktienanl. auf ThyssenKrupp	EUR	1'000.00	23.06.2015	23.06.2017	28 335 825		n.v.	100.00	100.00		0.000	Y
HVB Express-Zert. auf Euro Stoxx 50-Index	EUR	100.00	28.04.2015	30.06.2020	27 873 396		n.v.	98.868	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	100.00	31.10.2016	01.11.2021	34 263 502		n.v.	99.942	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'em. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%				
Vontobel Financial Products GmbH, Frankfurt, Deutschland													
4.4 % Reverse Convertible auf Fresenius	EUR	1'000.00	31.05.2016	09.06.2017	32 137 679		n.v.	100.00	100.00		0.000	Y	
Vontobel Financial Products Ltd, Vereinigte Arabische Emirate													
15 1/2 % Reverse Convertible on Schlumberger	USD	1'000.00	21.09.2015	21.01.2016	29 257 666		-	100.00	100.00	21.01.	0.40188	N	
15.33 % Reverse Convertible on ams	CHF	1'000.00	06.11.2015	08.02.2016	30 187 303		-	100.00	100.00	06.01. 08.02.	0.000 0.000	N	
5.72 % Reverse Convertible on Roche Hldg G	CHF	5'000.00	10.09.2015	10.02.2016	29 257 344		-	100.00	100.00	10.02.	0.000	N	
4.3 % Multi Defender Vonti on Indices	EUR	1'000.00	13.02.2013	15.02.2016	14 150 480		-	100.00	100.00	15.02.	8.831	N	
3.92 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.02.2015	26.02.2016	26 603 933		-	100.00	100.00	26.02.	1.418	N	
3.3 % Multi Defender Vonti on Indices	CHF	1'000.00	05.05.2014	06.05.2016	23 575 700		-	100.00	100.00	06.05.	0.850	N	
5.09 % (5.09025 % p.a.) Multi Defender Vonti on Equities	CHF	1'000.00	23.05.2014	24.05.2016	24 459 385		-	100.00	100.00	24.05.	0.075	N	
8.58 % Reverse Convertible on UBS Group N	CHF	1'000.00	29.09.2015	30.05.2016	29 257 842		-	100.00	100.00	29.03.	0.000	N	
7.95 % Reverse Convertible on Zurich Insur GrpN	CHF	5'000.00	04.12.2015	06.06.2016	30 188 243		-	100.00	100.00	30.05. 04.03.	0.000 0.000	N	
5.53 % Reverse Convertible on Adecco Group N	CHF	1'000.00	19.08.2015	20.06.2016	28 406 566		-	100.00	100.00	06.06. 19.02.	0.000 0.000	N	
9.12 % Reverse Convertible on Richemont N	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.06.2016	30 188 810		-	100.00	100.00	20.06. 29.03.	0.000 0.000	N	
5 % Multi Defender VONTI on Basket	CHF	1'000.00	05.08.2013	05.08.2016	14 150 778		-	100.00	114.30	28.06. 05.08.	3.000	N	
8.6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.05.2015	04.11.2016	24 173 368		-	100.00	100.00	04.02. 04.05. 04.08.	0.3157 0.3117 0.30718	N	
4.8.2016 Vorzeitige Rückzahlung													
4.08 % Reverse Convertible on Bayer N	EUR	1'000.00	10.11.2015	09.11.2016	30 187 373		-	100.00	100.00	10.05. 09.11.	0.60864 0.59293	N	
7.6 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	09.06.2015	09.12.2016	24 173 502		-	100.00	100.00	09.06. 09.12.	0.000 0.000	N	
4 % Reverse Convertible on Indices	AUD	1'000.00	18.06.2015	23.12.2016	28 405 064		-	100.00	100.00	23.06. 23.12.	7.824 7.936	N	
10 % Reverse Convertible on Richemont N	CHF	1'000.00	12.08.2016	25.01.2017	33 456 680		n.v.	100.00	100.00	14.11.	0.000	N	
9.41 % Reverse Convertible on Richemont N	CHF	1'000.00	25.08.2016	25.01.2017	33 457 385		n.v.	100.00	100.00	25.11.	0.000	N	
6.65 % Reverse Convertible on The Swatch Grp	CHF	5'000.00	25.08.2016	25.01.2017	33 457 384		n.v.	100.00	100.00	25.11.	0.000	N	
0.80 % (9.6 % p.a.) Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	30.12.2016	30.01.2017	34 838 675	%	99.60	100.00	100.00		0.000	Y	
11.13 % Reverse Convertible on UBS Group N	CHF	1'000.00	05.08.2016	06.02.2017	32 761 879		n.v.	100.00	100.00	07.11.	0.000	N	
6.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.08.2015	13.02.2017	24 173 610	%	75.60	100.00	100.00	15.02. 15.08.	0.000 0.000	N	
6.8 % Reverse Convertible Called for Red. on 13.12.16 at 100%	CHF	1'000.00	13.03.2015	13.03.2017	24 173 274		-	100.00	100.00	15.03. 15.06. 15.09. 15.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N	
13.12.2016 Vorzeitige Rückzahlung													
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.03.2015	17.03.2017	24 173 253	%	76.40	100.00	100.00	17.03. 19.09.	0.000 0.000	N	
10.46 % Reverse Convertible on Galenica N	CHF	10'000.00	20.10.2016	20.03.2017	34 181 283		n.v.	100.00	100.00		0.000	N	
4.45 % (19.77 % p.a.) Reverse Convertible on GoPro-A	CHF	1'000.00	30.12.2016	21.03.2017	34 838 679	%	99.50	100.00	100.00		0.000	Y	
9.22 % Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	22.11.2016	24.04.2017	34 182 989	%	101.10	100.00	100.00		0.000	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
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%			
6.48 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.05.2015	15.05.2017	24 173 437	%	99.10	100.00	100.00	15.02.	0.000	N
										17.05.	0.000	
										15.08.	0.000	
										15.11.	0.000	
6.52 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	22.11.2016	22.05.2017	34 182 988	%	97.30	100.00	100.00		0.000	N
8.9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.05.2015	29.05.2017	24 173 472	%	90.90	100.00	100.00	29.02.	0.000	N
										30.05.	0.000	
										29.08.	0.000	
										29.11.	0.000	
6 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.06.2015	08.06.2017	24 173 497	%	75.10	100.00	100.00	08.06.	0.000	N
										08.12.	0.000	
7.88 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.06.2015	12.06.2017	24 173 510	%	100.60	100.00	100.00	14.03.	0.000	N
										13.06.	0.000	
										12.09.	0.000	
										12.12.	0.000	
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.06.2016	22.06.2017	32 759 745		-	100.00	100.00	22.09.	0.000	N
										22.12.	0.000	
22.12.2016 Vorzeitige Rückzahlung												
6.33 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	28.06.2016	28.06.2017	32 759 994	%	100.70	100.00	100.00	28.12.	0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.08.2015	18.08.2017	24 173 620	%	102.20	100.00	100.00	18.08.	8.793	N
9.41 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	22.08.2016	22.08.2017	33 457 099	%	99.20	100.00	100.00		0.000	N
4.8 % (4.80891 % p.a.) Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	26.02.2016	25.08.2017	31 612 703	%	100.20	100.00	100.00	25.05.	0.000	N
										25.08.	0.000	
										25.11.	0.000	
6.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	25.08.2016	25.08.2017	33 457 387	%	98.40	100.00	100.00		0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.09.2016	19.09.2017	33 458 868	%	98.00	100.00	100.00	19.12.	0.000	N
5.8 % Reverse Convertible on Basket	CHF	1'000.00	22.09.2015	22.09.2017	29 257 591		-	100.00	100.00	22.03.	0.000	N
										22.06.	0.000	
										22.09.	0.000	
										22.12.	0.000	
22.12.2016 Vorzeitige Rückzahlung												
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.12.2016	22.12.2017	34 838 284	%	99.80	100.00	100.00		0.000	N
10.81 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	14.07.2016	15.01.2018	32 760 910	%	103.20	100.00	100.00		0.000	N
10.31 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.08.2016	05.02.2018	32 761 896		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5.54 % (5.5444 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.11.2016	05.02.2018	34 182 148	%	95.50	100.00	100.00		0.000	N
9.32 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.08.2016	08.02.2018	32 761 897		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
8.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.09.2016	08.03.2018	33 457 774	%	101.90	100.00	100.00		0.000	N
9.77 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	20.12.2016	20.03.2018	34 838 042	%	93.60		100.00		0.000	N
6.57 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	29.08.2016	29.03.2018	33 457 541	%	98.00	100.00	100.00		0.000	N
(1.9 % min.) Floored Floater with credit risk floating rate	EUR	1'000.00	02.05.2013	02.05.2018	14 150 651	%	101.50	100.00	100.00	02.02.	5.283	N
										02.05.	5.224	
										02.08.	5.254	
										02.11.	5.237	
4.67 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.10.2016	22.05.2018	34 181 222	%	91.90	100.00	100.00		0.000	N
4.93 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.05.2016	25.05.2018	32 150 953	%	97.30	100.00	100.00		0.000	N
3 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	05.06.2015	05.06.2018	24 173 459	%	95.70	100.00	100.00	07.03.	0.000	N
										06.06.	0.000	
										05.09.	0.000	
										05.12.	0.000	
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.06.2016	08.06.2018	32 150 970	%	97.50	100.00	100.00	08.09.	0.000	N
										08.12.	0.000	
3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.06.2015	12.06.2018	24 173 455	%	95.00	100.00	100.00	13.06.	0.000	N
5.98 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.12.2016	14.06.2018	34 837 764		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	30.12.2016	02.07.2018	34 838 641		n.v.	100.00	100.00		0.000	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
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%			
5.66 % Reverse Convertible on The Swatch Grp	CHF	5'000.00	25.07.2016	25.07.2018	32 761 400	%	101.20	100.00	100.00		0.000	N
4.15 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	27.07.2016	27.07.2018	32 761 509		n.v.	100.00	100.00		0.000	N
5 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.08.2016	15.08.2018	32 761 467	%	96.10	100.00	100.00		0.000	N
3 3/4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	11.09.2015	11.09.2018	24 173 674	%	97.20	100.00	100.00	11.03. 12.09.	0.000 0.000	N
8.96 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.09.2016	26.09.2018	33 459 231	%	100.30	100.00	100.00	27.12.	0.000	N
6.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.09.2016	28.09.2018	33 458 399	%	102.90	100.00	100.00		0.000	N
4.18 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	30.09.2016	28.09.2018	33 459 675	%	97.00	100.00	100.00		0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	30.09.2016	28.09.2018	33 458 832	%	100.30	100.00	100.00			N
3.59 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	03.10.2016	03.10.2018	33 459 713	%	93.60	100.00	100.00		0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.10.2016	12.10.2018	33 458 581	%	100.70	100.00	100.00		0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.10.2015	30.10.2018	29 258 353	%	92.20	100.00	100.00	01.02. 02.05. 02.08. 31.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.11.2015	06.11.2018	29 258 527	%	86.50	100.00	100.00	08.02. 06.05. 08.08. 07.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	06.11.2015	06.11.2018	29 258 518	%	96.20	100.00	100.00	08.02. 06.05. 08.08. 07.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
4.88 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	07.11.2016	07.11.2018	34 182 181	%	96.60	100.00	100.00		0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.11.2016	16.11.2018	34 182 103	%	98.70	100.00	100.00		0.000	N
(1.75 % min.) Floored Floater with reference bond floating rate	EUR	1'000.00	20.11.2013	20.11.2018	14 150 979	%	101.60	100.00	100.00	22.02.	5.030	N
										20.05. 22.08. 21.11.	5.083 4.977 4.741	
(2.5 % min.) Floored Floater with reference bond	EUR	1'000.00	20.12.2013	20.12.2018	14 150 986	%	103.20	100.00	100.00	21.03.	6.886	N
										20.06. 20.09. 20.12.	6.873 6.985 6.750	
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.12.2015	24.12.2018	30 188 328	%	89.80	100.00	100.00	27.12.	0.000	N
VONCERT on bonds	CNY	1'000.00	15.04.2014	21.01.2019	14 151 259	%	104.90		100.00		0.000	Y
(1.1 % min.) Floored Floater with reference bond floating rate	CHF	1'000.00	04.02.2014	04.02.2019	14 151 039	%	100.70	100.00	100.00	04.02.	2.750	N
										04.05. 04.08. 04.11.	2.750 2.811 2.811	
4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	12.02.2016	12.02.2019	30 189 012	%	97.90	100.00	100.00	12.05. 12.08. 14.11.	0.000 0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.03.2016	04.03.2019	31 613 021	%	85.10	100.00	100.00	06.06. 05.09. 05.12.	0.000 0.000 0.000	N
(2.75 % min.) Floored Floater Credit linked on Gazprom floating rate	EUR	1'000.00	19.03.2014	19.03.2019	14 151 130	%	103.40		100.00	21.03.	7.574	N
										20.06. 19.09. 19.12.	7.560 7.615 7.428	
5.5 % (5 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.04.2016	18.04.2019	31 614 590	%	96.80	100.00	100.00	18.07.	0.000	N
										18.10.	0.000	
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.04.2016	26.04.2019	32 148 809	%	95.00	100.00	100.00	26.07. 26.10.	0.000 0.000	N
(2.2 % min.) Floored Floater Credit Linked on Staples Inc.	EUR	1'000.00	18.06.2014	18.06.2019	24 172 706	%	103.50	100.00	100.00	18.03.	6.080	N
										20.06. 19.09. 19.12.	6.247 6.092 5.942	
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.07.2016	01.07.2019	32 759 587	%	98.40	100.00	100.00	03.10.	0.000	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
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%	CHF/%	CHF/%	
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.07.2016	29.07.2019	32 760 843	%	95.40	100.00	100.00	31.10.	0.000	N
4 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.07.2016	29.07.2019	32 760 836	%	92.20		100.00	31.10.	0.000	N
4 1/4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	29.07.2016	29.07.2019	32 761 062	%	98.00	100.00	100.00	31.10.	0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.08.2016	23.08.2019	32 762 035	%	96.60	100.00	100.00	23.11.	0.000	N
(2 % min.) Floored Floater Credit Linked on Fiat floating rate	EUR	1'000.00	02.09.2014	02.09.2019	24 172 857	%	101.10	100.00	100.00	02.03.	5.596	N
										31.05.	5.656	
										02.09.	5.592	
										02.12.	5.451	
9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.09.2016	02.09.2019	33 456 993	%	98.90	100.00	100.00	02.12.	0.000	N
Structured Note on Basket	EUR	1'000.00	13.11.2014	13.11.2019	24 172 959	%	97.10	100.00	100.00	15.02.	5.751	N
										13.05.	5.390	
										15.08.	5.684	
										14.11.	5.413	
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.11.2014	25.11.2019	24 173 048	CHF	948.00	98.765	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.09.2015	21.09.2020	29 257 674	CHF	895.00	100.00	100.00		0.000	N
Structured Note on Bonds	USD	1'000.00	05.11.2014	05.11.2020	24 172 941	%	101.90	100.00	100.00	05.02.	1.575	N
										05.05.	6.533	
										06.08.	6.859	
										07.11.	6.889	
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.11.2015	17.11.2020	30 187 642	CHF	1'016.00	100.00	100.00		0.000	Y
(min. 2.7 %) Structured Note credit linked on Anheuser-Busch	NZD	1'000.00	18.11.2015	18.11.2020	30 187 213	%	99.20	100.00	100.00	18.02.	4.760	N
										18.05.	4.485	
										18.08.	4.743	
										18.11.	4.828	
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.12.2015	15.12.2020	30 188 527	CHF	986.00	100.00	100.00		0.000	Y
Structured Note on Basket	EUR	1'000.00	02.02.2015	02.02.2021	24 173 093	%	95.00	100.00	100.00	02.02.	5.685	N
										02.05.	5.621	
										02.08.	5.530	
										02.11.	5.513	
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	15.04.2015	15.04.2021	24 173 355	CHF	942.00	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.11.2016	04.11.2021	34 182 109	CHF	1'060.00	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.11.2016	08.11.2021	34 182 197	CHF	1'035.00	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.12.2016	15.12.2021	34 837 863	CHF	1'008.00	100.00	100.00		0.000	Y
1.6 % Structured Note on 2.375 DBK 23 EMTN	CHF	1'000.00	28.12.2016	28.12.2021	34 183 702	%	99.30	100.00	100.00		0.000	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
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%	CHF/%	CHF/%	
Zuercher Kantonalbank Finance (Guernsey) Ltd, Guernsey												
13 % Equity Yield Note on Equities	CHF	1'000.00	20.11.2007	20.11.2008	3 507 666		-	100.00	100.00			N
8 1/2 % Barrier Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.05.2014	21.05.2015	23 873 050		-	100.00	100.00			N
5.48 % (5.4953 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.03.2015	11.03.2016	26 338 077		-	100.00	100.00	11.03.	1.220	N
7.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.10.2014	14.04.2016	21 478 044		-	100.00	100.00	14.01. 14.04.	0.075 0.075	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.06.2015	02.06.2016	24 244 673		-	100.00	100.00	02.06.	0.000	Y
8.06 % (8.105 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.06.2015	17.06.2016	28 440 179		-	100.00	100.00	17.06.	0.8405	N
6.48 % Reverse Convertible on Bayer N	EUR	1'000.00	10.08.2015	10.08.2016	28 440 663		-	100.00	100.00	10.02. 10.08.	0.91465 0.9101	N
11 1/2 % (5 3/4 % p.a.) ZKB BRC wof on Equities	CHF	1'000.00	26.08.2014	26.08.2016	24 482 434		-	100.00	100.00	26.08.	0.497	N
10.2 % (5.1 % p.a.) ZKB BRC wof on Indices	CHF	1'000.00	02.09.2014	02.09.2016	24 482 584		-		100.00	02.09.	0.384	N
9.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.03.2015	19.09.2016	26 337 960		-	100.00	100.00	21.03. 20.06. 19.09.	0.000 0.000 0.000	N
10 % (10.0559 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.10.2015	14.10.2016	29 551 811		-	100.00	100.00	16.04. 14.10.	4.195 4.257	N
8.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.04.2015	21.10.2016	24 244 062		-	100.00	100.00	21.04. 21.10.	0.000 0.000	N
12.00% (8.0597% p.a. Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	22.05.2015	18.11.2016	24 244 455		-	100.00	100.00	22.05. 18.11.	0.000 0.000	N
6.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.12.2014	02.12.2016	24 243 765		-	100.00	100.00	02.06. 02.12.	0.100 0.100	N
(no min.) Barrier Reverse Convertible on Basket	CHF	1'000.00	30.12.2013	27.12.2016	20 763 209		-	100.00	100.00	29.03. 27.06. 27.09. 27.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
3.8 % (1.9 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.02.2015	20.02.2017	26 337 786	%	102.04	100.00	100.00	22.02.	0.000	N
9.53 % (4.765 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.03.2015	03.03.2017	26 337 970		n.v.	100.00	100.00	03.03.	1.889	N
8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.09.2015	03.03.2017	28 440 732	%	92.54	100.00	100.00	03.03. 05.09.	0.000 0.000	N
10.4 % (2.6 % p.a.) ZKB Barrier Reverse Convertible on Basket	CHF	1'000.00	25.04.2013	25.04.2017	20 762 769		-	100.00	100.00	25.04.	3.000	N
1.52 % (4.5983 % p.a.) Reverse Convertible on Harley-Davidson	CHF	1'000.00	29.12.2016	28.04.2017	33 754 326	%	98.642	100.00	100.00		0.000	Y
2.25 % (6.8067 % p.a.) Reverse Convertible on Petroleo Br Sp ADR	CHF	1'000.00	29.12.2016	28.04.2017	33 754 324	%	99.620	100.00	100.00		0.000	Y
3.33 % (10.1593 % p.a.) Reverse Convertible on Trina Sp ADS	CHF	1'000.00	30.12.2016	28.04.2017	33 754 323	%	99.440	100.00	100.00		0.000	Y
1.51 % (4.6068 % p.a.) Reverse Convertible on Salzgitter	CHF	1'000.00	30.12.2016	28.04.2017	33 754 334	%	99.314	100.00	100.00		0.000	Y
3.6 % Reverse Convertible Called for red.on 26.01.17 at 100 %	CHF	1'000.00	26.01.2016	26.07.2017	25 318 695	%	101.05	100.00	100.00	26.07.	0.000	N
6.6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	20'000.00	02.08.2016	02.08.2017	32 698 878	%	100.094	100.00	100.00		0.000	N
7.02 % (6.8674 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.08.2016	25.08.2017	32 699 018	%	95.008	100.00	100.00		0.000	N
10 % (5.007 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.09.2015	08.09.2017	28 440 979	%	96.52	100.00	100.00	08.03. 08.09.	0.000 0.000	N
4.38 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.09.2016	22.09.2017	33 753 027	%	99.944	100.00	100.00		0.000	N
8 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.10.2015	16.10.2017	29 551 775	%	78.23	100.00	100.00	18.04. 17.10.	0.000 0.000	N
6.65 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.11.2016	24.11.2017	33 753 771	%	100.13	100.00	100.00		0.000	N
6.45 % (4.2921 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	31.05.2016	30.11.2017	31 596 319	%	95.25	100.00	100.00	01.12.	0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.04.2015	10.04.2018	24 243 803	%	98.41	100.00	100.00	11.04. 10.10.	0.000 0.000	N
4.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.05.2016	11.05.2018	31 596 082	%	97.33	100.00	100.00	11.11.	0.000	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
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%	CHF/%	CHF/%	
9.21 % (4.6114 % p.a.) Reverse Convertible on Julius Baer Grp N	CHF	20'000.00	07.07.2016	06.07.2018	32 698 658	%	103.788	100.00	100.00		0.000	N
13.87 % (6.9543 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	20'000.00	08.07.2016	06.07.2018	32 698 672	%	106.268	100.00	100.00		0.000	N
6.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.08.2015	13.08.2018	28 440 672	%	68.45	100.00	100.00	15.02. 13.05. 15.08. 14.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
2.3 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	02.10.2015	02.10.2018	29 551 713	%	100.03	100.00	100.00	04.04. 03.10.	0.000 0.000	N
4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	19.10.2015	19.10.2018	29 551 935	%	98.93	100.00	100.00	19.04. 19.10.	0.000 0.000	N
9.25 % (4.5805 % p.a.) Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	31.10.2016	07.11.2018	33 753 434	%	96.612	100.00	100.00		0.000	N
6.05 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.05.2016	03.05.2019	31 596 171	%	97.14	100.00	100.00	03.11.	0.000	N
11.25 % (3.7396 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	30.06.2016	03.07.2019	32 698 403	%	105.34	100.00	100.00		0.000	N
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	04.09.2015	04.09.2020	28 441 000	%	98.10	97.96	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	CHF	1'000.00	04.09.2015	04.09.2020	28 440 991	%	98.11	100.00	100.00	04.03. 05.09.	0.000 0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	25.09.2015	25.09.2020	28 440 888	%	93.96	100.00	100.00	29.03. 26.09.	0.000 0.000	N