

Korrekturjournal - Journal de corrections - Giornale di correzione

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

Inhaltsverzeichnis - Table des matières - Indice

Ausland	Derivative Finanzinstrumente	Kombinierte Produkte (H-Z)	
Etranger	Produits financiers dérivés	Produits combinés (H-Z)	
Eestero	Strumenti finanziari derivati	Prodotti combinati (H-Z)	2 - 16

**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/%	%	%	%	
HSBC Bank PLC, London, Grossbritannien												
5 % Worst-of Kick-In GOAL on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	24.04.2014	24.05.2017	23 701 820	%	102.68	100.00	100.00	25.04.	1.520	N
Maxi Autocallable Recovery Short 1/ Strike Put VRN on a Basket of Shs Senior	USD	1'000.00	09.06.2015	09.06.2017	27 690 710	%	83.32	98.19	100.00		0.000	Y
Maxi Autocallable Recovery short DI put VRN on a Basket of Indices	USD	1'000.00	23.06.2015	23.06.2017	28 320 374	%	98.63	98.08	100.00		0.000	Y
Worst-of Kick-In GOAL Notes VRN on a Basket of Shs Senior	USD	1'000.00	11.04.2014	11.07.2017	23 701 844	%	103.19	100.00	100.00	11.04.	8.285	N
Autocallable Reverse Convertible VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	29.07.2015	31.07.2017	28 320 525	%	104.58	98.093	100.00		0.000	Y
Autocallable Recovery Short DI put VRN on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	25.08.2015	25.08.2017	28 320 587	%	96.49	99.829	100.00		0.000	Y
Early Redemption Perles + on FTSE 100 Index Senior	USD	1'000.00	02.09.2014	05.09.2017	24 587 320	CHF	1'042.34	96.65	100.00		0.000	Y
Maxi Autocallable Recovery short DI put VRN on a Basket of Indices	USD	1'000.00	13.10.2015	12.10.2017	29 438 368	%	100.61	98.60	100.00		0.000	Y
Maxi Autocallable Recovery short DI put Notes VRN on a Basket of Shs Senior	USD	1'000.00	10.11.2014	13.11.2017	25 717 097	%	98.80	96.61	100.00		0.000	Y
Maxi Autocallable Recovery short DI put VRN on a Basket of Indices	USD	1'000.00	25.11.2015	27.11.2017	29 438 494	%	98.83	98.09	100.00		0.000	Y
Maxi Autocallable Recovery short DI put VRN on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	16.12.2015	18.12.2017	29 438 539	%	100.42	100.00	100.00		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a u g
			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												
Express Certificate with Contingent Memory VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	17.09.2014	16.09.2016	24 701 718		-	99.969	100.00		0.000	Y
Kick-In Certificate VRN on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	04.09.2014	04.09.2017	18 006 346	%	99.40	99.786	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.06.2016	28.12.2017	29 519 499	%	101.50	98.797	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.07.2016	05.01.2018	22 439 073	%	101.43	98.974	100.00		0.000	Y
Phoenix Autocall Certificates VRN on a Basket of Indices	USD	1'000.00	21.01.2016	21.01.2019	29 519 364	%	97.06	96.659	100.00		0.000	Y

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

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a u
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%	CHF/%		
Leonteq Securities AG, Guernsey Branch, Guernsey												
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.08.2015	25.11.2016	25 406 628		-	99.18	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.07.2015	03.01.2017	28 154 462	%	99.10	99.87	100.00		0.000	Y
Express Certificate on Saint Gobain	EUR	1'000.00	28.01.2014	20.01.2017	22 851 743	%	107.49	97.97	100.00		0.000	Y
Capital Protection-Cert.	GBP	1'000.00	31.01.2014	31.01.2017	22 850 858	%	110.33	86.50	90.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.12.2014	21.02.2017	25 609 244	%	0.02	98.11	100.00		0.000	Y
Express Certificate on Pan Amer Silver	USD	1'000.00	03.04.2014	03.04.2017	22 851 143	%	114.74	97.06	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Microsoft	USD	1'000.00	09.11.2015	09.05.2017	25 406 900	%	97.81	98.96	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	17.02.2016	17.05.2017	30 460 542	%	96.95	99.11	100.00		0.000	Y
Express Certificate 2014-15.05.17 on Equities	USD	1'000.00	20.05.2014	22.05.2017	24 203 691	%	97.37	97.26	100.00		0.000	Y
Capital Protection-Cert. on Equities	CHF	1'000.00	30.05.2014	30.05.2017	24 203 637	CHF	970.50	94.60	95.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.12.2015	21.06.2017	25 407 049	%	95.37	100.00	100.00		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	03.07.2014	03.07.2017	24 203 030	%	91.76	94.98	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.01.2016	11.07.2017	30 039 672	%	98.41	100.00	100.00	08.12.	0.000	Y
6.4 % Barrier Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	17.01.2014	17.07.2017	22 851 328	%	102.77	100.00	100.00	16.01.	1.800	N
										16.07.	1.800	
Reverse Convertible on The Swatch Grp	AUD	1'000.00	19.01.2016	19.07.2017	30 460 482	%	100.81	96.60	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.01.2016	20.07.2017	25 407 136	%	101.78	98.65	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	31.07.2015	31.07.2017	25 406 587	%	107.94	98.15	100.00		0.000	Y
Express-Cert. on Equities	USD	1'000.00	07.08.2014	07.08.2017	24 203 224	%	86.26	96.63	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.05.2016	31.08.2017	26 668 995	%	97.84	98.97	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	01.09.2015	01.09.2017	25 406 651	%	99.29	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.09.2015	11.09.2017	26 668 746	%	85.34	98.34	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.09.2014	18.09.2017	24 533 111	%	47.41	99.22	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.10.2014	31.10.2017	24 533 126	%	99.61	96.94	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.05.2016	06.11.2017	26 668 975	%	96.98	98.69	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.11.2015	10.11.2017	26 668 938	%	99.49	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	CHF	1'000.00	22.12.2015	22.12.2017	30 460 397	%	86.82	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.12.2016	27.12.2017	31 524 898	%	100.07	100.00	100.00		0.000	Y
9.55 % (9.42 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.12.2016	05.01.2018	34 820 216	%	106.30	100.00	100.00		0.000	Y
11.05 % (10.9 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.12.2016	05.01.2018	34 820 215	%	107.26	100.00	100.00		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	04.05.2015	04.05.2018	26 668 540	%	116.12	100.00	100.00		0.000	Y
Barrier Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	24.06.2014	26.06.2018	24 533 370	%	1.00	99.24	100.00	23.06. 19.12.	2.779 2.750	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/%	CHF/%		
Notenstein Finance (Guernsey) Ltd, St Peter Port, Guernsey												
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.02.2015	02.02.2017	24 972 007	%	104.14	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.02.2015	27.02.2017	24 972 054	%	107.68	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Pernod Ricard	EUR	1'000.00	28.08.2015	28.02.2017	26 243 451	%	104.85	99.91	100.00		0.000	Y
Protection Participation on IBM	USD	1'000.00	25.02.2016	01.03.2017	31 525 457	%	94.35	94.34	95.00		0.000	Y
5.87 % (11.62 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.08.2016	02.03.2017	32 950 990	%	103.33	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.03.2015	03.03.2017	24 972 064	%	99.21	98.34	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.03.2015	10.03.2017	24 972 070	%	106.79	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.03.2015	10.03.2017	24 972 069	%	106.41	99.80	100.00		0.000	Y
7 1/4 % Reverse Convertible on Ferrari	CHF	1'000.00	22.03.2016	22.03.2017	30 324 529	%	106.92	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.03.2015	24.03.2017	24 972 104	%	108.32	99.82	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.04.2015	07.04.2017	24 972 122	%	97.67	98.42	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.04.2015	10.04.2017	24 972 123	%	108.51	100.00	100.00		0.000	Y
10 1/2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.04.2016	18.04.2017	30 324 653	%	50.11	100.00	100.00		0.000	Y
7 1/4 % Reverse Convertible on Air France - KLM	EUR	1'000.00	25.04.2016	25.04.2017	30 324 710	%	70.34	100.00	100.00		0.000	Y
Protection Participation on Apple	USD	1'000.00	26.04.2016	26.04.2017	31 525 687	%	94.93	94.28	95.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.04.2015	28.04.2017	24 972 129	%	107.82	100.00	100.00		0.000	Y
9 1/2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.04.2016	28.04.2017	31 525 698	%	102.73	100.00	100.00		0.000	Y
11.35 % (15.9 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.08.2016	28.04.2017	32 674 109	%	105.44	100.00	100.00		0.000	Y
Protection Participation on Apple	USD	1'000.00	03.05.2016	03.05.2017	31 525 722	%	94.90	93.85	95.00		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.04.2016	04.05.2017	31 525 702	%	102.43	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.05.2015	08.05.2017	24 972 155	%	102.41	99.88	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.05.2015	08.05.2017	24 972 157	%	102.82	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Swisscom N	EUR	1'000.00	07.03.2016	08.05.2017	30 324 045	%	92.92	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.11.2015	09.05.2017	28 371 658	%	79.50	100.00	100.00		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on OC Oerlikon N	CHF	1'000.00	09.11.2015	09.05.2017	24 972 333	%	101.29	100.00	100.00	05.02.	0.000	N
										06.05. 05.08. 07.11.	0.000 0.000 0.000	
Reverse Convertible on BMW	EUR	1'000.00	02.05.2016	09.05.2017	30 324 734	%	95.22	100.00	100.00		0.000	Y
15 1/4 % Reverse Convertible on Hertz Global Hldgs	USD	1'000.00	10.05.2016	10.05.2017	31 525 261	%	79.84	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.05.2015	11.05.2017	27 476 295	%	130.21	98.30	100.00		0.000	Y
3 1/2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	12.11.2015	12.05.2017	24 972 331	%	99.91	100.00	100.00	10.02. 11.05. 10.08. 10.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
7 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	12.11.2015	12.05.2017	24 972 332	%	98.91	100.00	100.00	10.02. 11.05. 10.08. 10.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Tesla Motors	EUR	1'000.00	16.02.2016	16.05.2017	30 324 450	%	97.88	100.00	100.00		0.000	Y
Protection Participation on EUR/USD	EUR	1'000.00	16.05.2016	16.05.2017	32 338 966	%	97.07	90.00	90.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Tesla Motors	USD	1'000.00	17.02.2016	17.05.2017	30 324 449	%	96.45	99.13	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Novartis N	CHF	1'000.00	19.02.2016	19.05.2017	31 525 401	%	89.73	100.00	100.00		0.000	Y
Protection Participation on Crude Oil	USD	1'000.00	19.05.2016	19.05.2017	31 525 346	%	101.05	89.33	90.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Zurich Insur GrpN	CHF	205.60	22.02.2016	22.05.2017	31 525 405	CHF	286.35	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Apple	USD	50'000.00	13.05.2016	22.05.2017	30 324 807	%	118.66	99.22	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on The Swatch Grp	CHF	324.00	23.02.2016	23.05.2017	31 525 404	CHF	332.58	99.97	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.11.2015	24.05.2017	27 475 991	%	95.02	98.84	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Technip	CHF	1'000.00	24.02.2016	24.05.2017	31 525 447	%	98.61	100.00	100.00		0.000	Y
Protection Participation on EUR/USD	USD	1'000.00	25.05.2016	25.05.2017	32 339 053	%	97.32	89.19	90.00		0.000	Y
Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	35.34	19.02.2016	29.05.2017	31 525 406	CHF	49.16	99.97	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible 2015-6.6.17 on Equities	CHF	1'000.00	03.12.2015	06.06.2017	30 324 146	%	78.91	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Allianz N	EUR	1'000.00	07.03.2016	07.06.2017	30 324 046	%	120.55	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	07.03.2016	07.06.2017	30 324 024	%	105.95	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Diageo	GBP	16.78	10.05.2016	12.06.2017	32 338 816	CHF	22.85	99.14	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	11.12.2015	13.06.2017	30 324 225	%	100.69	99.95	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	14.03.2016	14.06.2017	30 324 104	%	117.83	100.00	100.00		0.000	Y
7.52 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	32 571 100	%	106.41	100.00	100.00		0.000	Y
8.52 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	32 571 101	%	107.42	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	03.07.2015	03.07.2017	24 972 206	%	108.67	99.74	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Walt Disney	USD	1'000.00	19.01.2016	17.07.2017	30 324 275	%	98.46	98.55	100.00		0.000	Y

**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/%			
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.07.2016	20.07.2017	32 950 790	%	133.14	99.32	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.07.2016	20.07.2017	32 950 787	%	131.89	99.32	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Bouygues	EUR	1'000.00	21.04.2016	21.07.2017	30 324 689	%	100.76	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	24.07.2015	24.07.2017	24 972 222	%	54.65	99.80	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Novartis N	EUR	64.60	29.06.2016	31.07.2017	32 673 953	CHF	68.92	100.00	100.00		0.000	Y
2.6 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	02.05.2016	02.08.2017	30 324 761	%	98.30		100.00	30.05. 30.06. 28.07. 30.08. 29.09. 28.10. 30.11. 30.12.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on K+S N	EUR	18.67	07.06.2016	07.08.2017	32 673 839	CHF	21.44	100.00	100.00		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Alphabet-A	USD	5'000.00	10.08.2016	10.08.2017	32 950 904	%	98.70	100.00	100.00		0.000	Y
6 1/2 % Reverse Convertible on Alphabet-A	USD	5'000.00	10.08.2016	10.08.2017	32 950 905	%	98.26	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.02.2016	15.08.2017	30 324 423	%	80.30	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	23.02.2015	23.08.2017	24 972 039	%	78.51	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ams	CHF	23.50	23.05.2016	23.08.2017	32 339 007	CHF	27.13	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.02.2016	28.08.2017	31 525 469	%	77.85	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.08.2016	29.08.2017	32 674 115	%	99.56	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Deutsche Bank N	USD	1'000.00	03.03.2016	01.09.2017	31 525 491	%	66.40	98.89	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.03.2016	04.09.2017	31 525 483	%	39.94	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Hennes&Mauritz -B-	EUR	219.40	06.07.2016	05.09.2017	32 673 987	CHF	238.94	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on ams	USD	1'000.00	07.03.2016	07.09.2017	30 324 048	%	98.46	98.81	100.00		0.000	Y
5.31 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.09.2015	08.09.2017	28 371 487	%	81.98	100.00	100.00	08.09.	0.000	N
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	08.09.2015	08.09.2017	28 371 473	%	74.33	98.24	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	EUR	1'000.00	11.09.2015	11.09.2017	28 371 471	%	90.65	99.82	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.09.2015	11.09.2017	28 371 500	%	8.21	98.36	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	11.03.2016	11.09.2017	31 525 529	%	104.74	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	17.09.2015	12.09.2017	27 476 320	%	80.15	98.37	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.09.2015	14.09.2017	28 371 463	%	66.51	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Richemont N	CHF	62.40	19.02.2016	19.09.2017	31 525 407	CHF	67.50	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.03.2016	25.09.2017	31 525 596		-	100.00	100.00		0.000	Y
25.4.2016 Vorzeitige Rückzahlung												
Reverse Convertible on Funds	CHF	1'000.00	29.09.2014	29.09.2017	22 829 700	%	98.07	99.85	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	22.09.2015	29.09.2017	27 476 321	%	59.70	98.31	100.00		0.000	Y
8.4 % (8.423398 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.09.2016	29.09.2017	33 245 870	%	105.45	100.00	100.00		0.000	Y
3.46 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	01.04.2015	02.10.2017	24 972 088	%	98.98	100.00	100.00	05.04. 29.09.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Tesla Motors	USD	1'000.00	11.04.2016	11.10.2017	31 525 637	%	108.79	98.78	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Commodities	USD	1'000.00	24.10.2014	24.10.2017	24 972 773	%	44.77	97.09	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Fortescue Metals	AUD	100'000.00	19.10.2016	26.10.2017	34 081 320	%	76.26	98.27	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Sears Holdings	USD	1'000.00	29.04.2016	30.10.2017	31 525 715	%	34.25	98.71	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	31.05.2016	30.10.2017	32 571 283	%	99.87	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.06.2016	30.10.2017	32 673 910	%	68.18	98.97	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Hertz Global Hldgs	EUR	1'000.00	02.05.2016	01.11.2017	31 525 720	%	31.15	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.11.2015	06.11.2017	28 371 649	%	88.98	98.54	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	06.05.2016	06.11.2017	30 324 774	%	104.30	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.11.2014	13.11.2017	25 141 784	%	64.70	99.19	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.08.2016	17.11.2017	32 950 934	%	104.18	98.85	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2015	20.11.2017	30 324 126	%	101.81	98.11	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	20.05.2016	20.11.2017	31 525 335	%	99.31	98.97	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur GrpN	USD	1'000.00	27.11.2015	27.11.2017	27 476 000	%	107.93	98.15	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Accor	EUR	1'000.00	07.12.2015	07.12.2017	27 476 032	%	102.24	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	07.06.2016	07.12.2017	32 338 895	%	96.50	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	USD	1'000.00	08.12.2015	08.12.2017	27 476 034	%	115.45	98.05	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P GSCI Crd OilER	USD	1'000.00	07.06.2016	08.12.2017	32 571 317	%	103.86	98.59	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	18.12.2015	18.12.2017	27 476 088	%	112.53	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.12.2015	18.12.2017	27 476 041	%	93.92	98.05	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	EUR	21.86	23.03.2016	22.03.2018	31 525 601	CHF	23.59	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.03.2016	05.04.2018	31 525 581	%	37.01	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.11.2016	10.05.2018	33 705 876	%	96.73	98.52	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.06.2016	06.06.2018	32 571 306	%	46.43	100.00	100.00		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a u
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%	CHF/%	CHF/%	
Protection Participation on Indices	CHF	1'000.00	26.06.2015	26.06.2018	27 476 385	%	98.15	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	11.08.2016	10.08.2018	32 674 103	%	104.30	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.08.2016	06.09.2018	32 571 255	%	98.07	98.05	100.00		0.000	Y
7.09 % Structured Note on ANGLO AMERICAN	USD	1'000.00	22.02.2016	10.01.2019	31 525 437	%	109.33	100.00	100.00	11.07.	26.910	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.05.2016	06.05.2019	31 524 663	%	64.16	97.26	100.00	28.10.	29.803	Y
Reverse Convertible on EDF	EUR	1'000.00	14.07.2016	15.07.2019	32 674 021	CHF	1'056.54	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	07.11.2014	07.11.2019	24 972 786	%	47.32	91.60	100.00		0.000	Y
Protection Participation on Equities	CHF	1'000.00	22.12.2014	23.12.2019	24 972 819	%	96.83	94.38	95.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.05.2015	11.05.2020	24 972 153	%	72.03	91.87	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.05.2015	11.05.2020	24 972 151	%	70.90	91.87	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.06.2016	02.06.2020	32 338 824	%	71.92	95.11	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	02.06.2016	02.06.2020	32 338 823	%	76.96	95.95	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Total	EUR	100.00	21.09.2016	21.09.2020	33 705 918	CHF	111.25	100.00	100.00		0.000	Y
Protection Participation on Equities	CHF	1'000.00	05.12.2014	07.12.2020	24 972 735	%	97.96	94.57	96.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Volkswagen Vz	EUR	100.00	15.07.2016	15.07.2021	32 673 979	CHF	111.80	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	100.00	13.08.2015	12.08.2021	28 371 435	CHF	99.59	96.59	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTXbnk EUR P	EUR	100.00	03.11.2015	19.07.2022	28 371 646	CHF	100.45	96.58	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	100.00	09.09.2016	09.09.2022	33 705 896	CHF	108.62	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	100.00	13.12.2016	09.12.2022	34 081 449	CHF	107.10	98.69	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/%	%	%	%	
Raiffeisen Switzerland B.V., Amsterdam, Niederlande												
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
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.05.2016	17.05.2018	32 338 976	%	103.02	98.30	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	CHF	1'000.00	24.11.2016	17.05.2018	33 705 993	%	97.52	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.11.2016	29.05.2018	34 081 051	%	99.08	98.27	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	22.08.2016	22.08.2018	32 950 964	%	97.72	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.11.2016	16.11.2018	33 705 986	%	99.24	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.11.2016	21.11.2018	33 705 983	%	98.44	97.87	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
Reverse Convertible on AB InBev	USD	1'000.00	14.11.2016	14.05.2019	33 705 882	%	100.61	97.35	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.12.2016	30.12.2019	33 875 443	%	98.42	94.96	100.00		0.000	Y
Structured Note on Equities	USD	1'000.00	09.03.2016	09.03.2020	31 525 514	%	99.63	97.55	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.05.2016	22.05.2020	32 338 991	%	76.54	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.12.2016	29.06.2020	34 412 540	%	98.71	100.00	100.00		0.000	Y
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	17.05.2016	17.05.2021	32 338 981	%	97.26	94.40	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	07.06.2016	07.06.2021	32 571 226	%	98.30	94.68	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	16.06.2016	16.06.2021	32 571 225	%	98.27	94.40	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	100.00	17.06.2015	17.06.2021	27 476 382	CHF	108.23	95.56	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on STXE6O&G EUR P	EUR	1'000.00	07.07.2016	07.07.2021	32 571 233	%	103.09	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	100.00	04.03.2015	02.08.2021	26 243 415	CHF	105.36	97.60	100.00	02.08.	0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	100.00	03.11.2015	03.11.2021	28 371 626	CHF	108.66	97.69	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	100.00	08.12.2015	09.12.2021	27 476 039	CHF	106.63	98.34	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	29.12.2016	29.12.2021	33 875 458	%	98.35	90.44	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	31.05.2016	17.05.2022	32 338 820	%	102.72	93.79	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on STXE6O&G EUR P	EUR	1'000.00	08.06.2016	08.06.2022	32 338 819	%	103.62	99.46	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	09.06.2016	09.06.2022	30 050 286	%	93.85	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Societe Generale	EUR	1'000.00	24.06.2016	24.06.2022	32 571 122	%	112.14	99.76	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	27.06.2016	27.06.2022	32 338 988	%	90.17	92.93	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTXbnk EUR P	EUR	100.00	04.09.2015	05.07.2022	28 371 477	CHF	100.14	95.47	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.12.2016	30.12.2022	33 875 444	%	99.11	98.57	100.00		0.000	Y
Royal Bank of Canada, Toronto, Kanada												
1.8 % (3.6 % P.A.) Barrier Reverse Convertible Notes on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	20.03.2015	20.09.2017	25 280 563	%	98.54	100.00	100.00	21.03.	0.04986	N
										20.09.	0.05013	
Memory Phoenix Autocallable Notes Variable Rate on a Basket of Shs	USD	1'000.00	07.10.2014	06.10.2017	25 280 365	%	94.87	96.088	100.00		0.000	Y
3.525 % (7.05 % P.A.) Double Coupon Autocallable Notes on a Basket of Shs	USD	1'000.00	20.11.2015	20.11.2017	27 621 035	%	105.80	100.00	100.00	20.05.	4.569	N
										20.11.	4.605	
1.175 % (4.7 % P.A.) Barrier Reverse Convertible Notes on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	02.12.2015	04.12.2017	27 621 057	%	96.47	100.00	100.00	10.03.	0.000	N
										09.06.	0.000	
										09.09.	0.000	
										09.12.	0.000	
0.78 % (9.36 % P.A.) Reverse Convertible Autocallable Notes on a Basket of Shs	USD	1'000.00	17.12.2015	18.12.2017	27 621 083	%	98.74	100.00	100.00	19.01.	0.94359	N
										19.02.	0.87577	
										19.03.	0.79969	
										19.04.	0.84784	
										19.05.	0.84621	
										19.06.	0.84474	
										19.07.	0.84198	
										19.08.	0.84748	
										19.09.	0.86535	
										19.10.	0.84559	
										19.11.	0.89134	
										19.12.	0.87518	
2.7 % Barrier Reverse Convertible Notes on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	19.03.2015	19.03.2019	25 280 510	%	94.77	100.00	100.00	21.03.	0.000	N
										20.06.	0.000	
										19.09.	0.000	
										19.12.	0.000	

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a u
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF					
Royal Bank of Canada, London Branch, London, Grossbritannien												
Memory Phoenix Autocallable Notes VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	19.03.2014	20.03.2017	23 070 447	%	99.59	97.509	100.00	19.03.		Y
0.64 % (2.56 % P.A.) Reverse Convertible Autocallable Notes on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	23.06.2015	23.06.2017	27 620 338	%	97.27		100.00	23.06.	0.000	N
										23.09.	0.000	
										23.12.	0.000	
1 7/8 % (7 1/2 % P.A.) Reverse Convertible Notes on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	09.09.2015	12.09.2017	27 620 430	%	98.38	100.00	100.00	09.03.	0.000	N
										09.06.	0.000	
										09.09.	0.000	
										09.12.	0.000	
5 1/2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	10.04.2015	10.10.2017	26 281 976	%	98.08	100.00	100.00	08.04.	0.000	N
										10.10.	0.000	
Phoenix Autocallable Notes VRN on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	20.11.2015	20.11.2017	27 620 490	%	98.55	100.00	100.00		0.000	Y
Memory Phoenix Autocallable Notes VRN on a Basket of Shs S23471	CHF	1'000.00	11.08.2015	11.08.2020	29 135 988	%	76.98	100.00	100.00		0.000	Y

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

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a u
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%			
SG Issuer SA, Luxemburg												
8.9972 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.05.2015	29.04.2016	27 793 156		-	100.00	100.00		0.000	Y
Phoenix on Shares-Basket	USD	1'000.00	19.02.2015	21.02.2017	25 951 961	%	90.18	98.18	100.00		0.000	Y
10 1/2 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.05.2016	19.05.2017	32 332 541	%	99.69	100.00	100.00		0.000	Y
6.147 % (pro rata) Reverse Convertible on Crude Oil	USD	1'000.00	12.09.2016	12.06.2017	32 737 776	%	101.39	100.00	100.00		0.000	Y
1.1 % (4.4 % p.a.) Barrier Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	24.06.2014	26.06.2017	24 562 483	%	95.44	100.00	100.00	29.03.	1.091	N
										27.06.	1.076	
										26.09.	1.089	
										27.12.	1.075	
Express Certificate on basket of 3 Index	EUR	1'000.00	16.07.2014	17.07.2017	24 562 654	CHF	1'065.81	98.868	100.00		0.000	Y
2.15 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	08.11.2016	09.08.2017	32 738 595	%	100.89	100.00	100.00		0.000	Y
0.59 % (pro rata) Reverse Convertible on Crude Oil	CHF	1'000.00	14.11.2016	14.08.2017	32 738 575	%	102.39	100.00	100.00		0.000	Y
5.25 % (7 % p.a.) Reverse Convertible on Crude Oil	CHF	1'000.00	23.11.2016	23.08.2017	32 738 674	%	103.10	100.00	100.00		0.000	Y
6.75 % (9 % p.a.) Reverse Convertible on Crude Oil	USD	1'000.00	23.11.2016	23.08.2017	32 738 678	%	102.96	100.00	100.00		0.000	Y
8.4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.09.2016	01.09.2017	32 737 700	%	99.05	100.00	100.00		0.000	N
5.45 % Barrier Reverse Convertible on Index-Basket	CHF	1'000.00	02.09.2015	04.09.2017	28 346 614	%	98.37	100.00	100.00	04.03.	0.000	N
										05.09.	0.000	
6 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.10.2016	09.10.2017	32 737 931	%	94.37	100.00	100.00		0.000	Y
8.3 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.10.2016	12.10.2017	32 738 135	%	97.12	100.00	100.00		0.000	Y
1 % (4 % P.A.) Callable Barrier Reverse Convertible on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	06.11.2014	06.11.2017	25 273 783	%	98.12	100.00	100.00	08.02.	10.301	N
										06.05.	9.643	
										08.08.	10.301	
										07.11.	9.972	
3 1/8 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.05.2016	13.11.2017	32 332 624	%	94.82	100.00	100.00	15.08.	1.981	N
										14.11.	2.646	
Bonus Certificate on a Basket of Shs	USD	1'000.00	18.11.2014	20.11.2017	25 885 247	CHF	223.43	96.613	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.12.2016	08.12.2017	32 738 852	%	99.36	98.893	100.00		0.000	Y
6 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.12.2016	12.12.2017	32 738 946	%	101.55	100.00	100.00		0.000	Y
Phoenix on Shares-Basket	EUR	1'000.00	18.12.2015	18.12.2017	28 347 445	%	96.56	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.08.2016	29.12.2017	32 333 887	%	94.67	100.00	100.00		0.000	Y
Buy on Dips Note on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	28.08.2015	28.08.2018	28 346 428	%	95.52	94.717	100.00		0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.09.2016	24.09.2018	32 737 943	%	97.08	97.971	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on UBS Group N	EUR	1'000.00	20.10.2016	22.10.2018	32 738 326	%	100.28	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.11.2016	05.11.2018	32 738 540	%	98.09	100.00	100.00		0.000	Y
3/4 % (3 % p.a.) Barrier Reverse Convertible on Index-Basket	CHF	1'000.00	18.12.2014	18.12.2018	25 951 429	%	95.12	100.00	100.00	18.03.	0.200	N
										20.06.	0.200	
										19.09.	0.200	
										19.12.	0.250	
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.11.2016	04.11.2019	32 738 528	%	85.14	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.12.2016	09.12.2019	34 820 496	%	98.85	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.10.2016	20.10.2021	32 738 322	%	97.82	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	24.11.2016	24.11.2022	32 738 803	%	100.53	100.00	100.00		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

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

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

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a u
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%			
UBS AG, Jersey Branch, St Helier, Jersey												
3.8 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	14.07.2015	13.01.2017	28 649 866	%	100.51	100.00	100.00	13.01. 13.04. 13.07. 13.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on BP	GBP	1'000.00	01.06.2015	30.05.2017	28 182 707	%	99.80	98.022	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	15.10.2014	17.10.2017	25 639 144	%	100.92	96.48	100.00		0.000	Y
UBS AG, London Branch, London, Grossbritannien												
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	12.03.2015	13.03.2017	27 270 958	%	103.94	98.22	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.11.2015	08.05.2017	30 100 055	%	99.94	99.97	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	09.11.2015	09.05.2017	30 155 739	%	99.84	98.97	100.00		0.000	Y
7.9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.11.2015	11.05.2017	30 155 976	%	100.70	100.00	100.00	11.02. 12.05. 11.08. 11.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Floating Rate Barrier Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	03.06.2014	06.06.2017	24 519 307	%	100.00	100.00	100.00	04.03. 06.06. 05.09. 05.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
25.65 % Reverse Convertible on Intesa Sanpaolo	EUR	1'000.00	06.12.2016	23.06.2017	34 706 465	%	105.68	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	5'000.00	02.02.2016	02.08.2017	31 168 591	%	100.84	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	5'000.00	02.02.2016	03.08.2017	31 168 592	%	100.62	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	11.08.2015	11.08.2017	28 986 068	%	94.23	98.418	100.00		0.000	Y
10.40 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.08.2015	21.08.2017	29 124 611	%	82.80	100.00	100.00	19.02. 20.05. 19.08. 21.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Kick-In Certificate on Indices	CHF	1'000.00	05.09.2014	05.09.2017	25 310 713	%	99.83	99.79	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on FTSE 100	USD	1'000.00	12.09.2014	12.09.2017	25 385 559	CHF	1'046.78	96.61	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.09.2014	18.09.2017	25 420 741	%	112.15	96.422	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on ABB N	CHF	17.29	23.01.2015	25.09.2017	26 727 235	CHF	22.07	99.97	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.10.2015	05.10.2017	29 656 934	%	103.40	98.38	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on ABB N	CHF	18.15	10.02.2015	10.10.2017	26 996 368	CHF	21.89	99.97	100.00		0.000	Y
4.8 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	25.10.2016	27.10.2017	34 217 757	%	100.83	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	30.04.2015	30.10.2017	27 886 744	%	106.25	97.537	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	30.04.2015	30.10.2017	27 886 743	%	104.39	99.999	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	04.11.2015	06.11.2017	30 100 062	%	99.21	99.92	100.00		0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Euro Stoxx 50 Index	CHF	1'000.00	17.11.2015	17.11.2017	30 100 130	%	99.21	100.00	100.00	17.02. 17.05. 17.08. 17.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	18.11.2016	17.11.2017	34 480 555	%	97.39	98.50	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.11.2015	20.11.2017	30 214 752	%	94.43	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2015	20.11.2017	30 214 417	%	101.32	98.08	100.00		0.000	Y
11.20 % Reverse Convertible on Barrick Gold	USD	1'000.00	21.11.2016	27.11.2017	34 480 312	%	102.38	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Syngenta N	CHF	5'000.00	03.11.2014	05.12.2017	25 934 384	CHF	408.25	99.78	100.00		0.000	Y
4.2 % Worst-Of Kick-In GOAL on Indices	CHF	1'000.00	10.12.2013	11.12.2017	22 893 531	%	99.77	100.00	100.00	10.06. 10.12.	1.800 1.800	N
8 1/4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.12.2015	11.12.2017	30 297 910	%	98.00		100.00	09.03. 09.06. 09.09. 09.12.	2.490 2.411 2.441 2.550	N
Reverse Convertible on Indices	USD	5'000.00	24.06.2016	26.12.2017	32 889 795	%	98.70	98.84	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	18.03.2015	19.03.2018	27 271 240	%	95.48	100.00	100.00	17.03. 17.09.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Indices	USD	5'000.00	21.12.2016	21.12.2021	34 848 136	%	98.76	90.428	100.00		0.000	Y

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

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a u
			Em.preis prix d'em. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	CHF/%	CHF/%			
Vontobel Financial Products Ltd, Vereinigte Arabische Emirate												
4.6 % Multi Defender Vonti on Commodities	CHF	1'000.00	13.02.2013	15.02.2016	14 150 436		-	100.00	100.00	15.02.	2.400	N
Underlying Tracker on Syngenta N	CHF	316.00	08.10.2015	10.10.2016	29 258 155		-	100.00	100.00		0.000	Y
9 3/4 % (9.16 % p.a.) Reverse Convertible on Alcoa	USD	1'000.00	30.11.2015	23.12.2016	30 187 727		-	100.00	100.00	23.12.	10.720	Y
4.4 % (4.38 % p.a.) Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	12.02.2016	13.02.2017	30 939 396	%	100.20	100.00	100.00			Y
(1 1/8 % min.) Floored Floater on 3 month CHF with reference bond	CHF	1'000.00	17.02.2012	17.02.2017	14 149 890	%	100.10	100.00	100.00	17.02.	2.875	N
										17.05.	2.875	
										17.08.	2.875	
										17.11.	2.875	
(no min.) Floater Multi Defender VONTI on Equities	CHF	1'000.00	20.02.2014	20.02.2017	14 151 107	%	99.80	100.00	100.00	22.02.	0.000	N
										20.05.	0.000	
										22.08.	0.000	
										21.11.	0.000	
7.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.03.2016	08.03.2017	31 613 189	%	100.40	100.00	100.00		0.000	N
(1 3/4 % min.) with credit risk	CHF	1'000.00	17.02.2012	06.04.2017	14 149 909	%	100.30	100.00	100.00	06.01.	4.472	N
										06.04.	4.375	
										06.07.	4.423	
										06.10.	4.472	
6 1/4 % (5.66 % p.a.) Reverse Convertible on Syngenta N	CHF	1'000.00	22.04.2016	29.05.2017	32 149 000	%	97.10	100.00	100.00		0.000	Y
4.8 % (4.43 % p.a.) Reverse Convertible on Syngenta N	CHF	1'000.00	29.04.2016	29.05.2017	32 149 725	%	101.00	100.00	100.00		0.000	Y
5.02 % (5 % p.a.) Reverse Convertible on Syngenta N	CHF	1'000.00	27.05.2016	29.05.2017	32 151 134	%	97.80	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.06.2015	01.06.2017	24 173 475	CHF	1'059.04	98.323	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	03.06.2016	06.06.2017	32 151 322	CHF	995.00	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.06.2016	13.06.2017	32 151 194	CHF	956.00	100.00	100.00		0.000	Y
7.35 % (7.19 % p.a.) Reverse Convertible on Syngenta N	CHF	1'000.00	15.06.2016	23.06.2017	32 759 334	%	96.50	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	03.07.2015	03.07.2017	24 173 553	CHF	1'063.42	99.742	100.00		0.000	Y
4.55 % Reverse Convertible on Indices	CHF	100.00	03.07.2015	03.07.2017	24 173 549	%	99.60	100.00	100.00	04.01.	0.000	N
										04.04.	0.000	
										04.07.	0.000	
										03.10.	0.000	
9 3/4 % (8.27 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.05.2016	10.07.2017	32 150 070	%	99.10	100.00	100.00		0.000	N
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	27.10.2016	27.07.2017	34 181 684	CHF	1'068.78	100.00	100.00		0.000	Y
6.65 % (6.07 % p.a.) Reverse Convertible on Syngenta N	CHF	1'000.00	24.06.2016	28.07.2017	32 759 413	%	98.60	100.00	100.00		0.000	Y
4 1/4 % (3.92 % p.a.) Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	28.06.2016	28.07.2017	32 760 003	%	100.50	100.00	100.00		0.000	Y
5.55 % (5.32 % p.a.) Reverse Convertible on Syngenta N	CHF	1'000.00	13.07.2016	28.07.2017	32 760 837	%	98.20	100.00	100.00		0.000	Y
Underlying Tracker on Syngenta N	CHF	380.30	23.08.2016	25.08.2017	33 457 212	CHF	391.00	100.00	100.00		0.000	Y
5.4 % Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	30.08.2016	30.08.2017	33 457 621	%	102.20	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.08.2016	30.08.2017	33 457 729	CHF	1'056.99	100.00	100.00		0.000	Y
5.15 % Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	01.09.2016	01.09.2017	33 457 822	%	101.70	100.00	100.00		0.000	Y
4 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	04.09.2015	04.09.2017	24 173 639	%	96.70	100.00	100.00	04.03.	0.000	N
										06.06.	0.000	
										05.09.	0.000	
										05.12.	0.000	
5.15 % (4.8 % p.a.) Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	26.08.2016	22.09.2017	33 456 967	%	101.40	100.00	100.00		0.000	Y
7.30 % (8.96 % p.a.) Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	29.11.2016	22.09.2017	34 183 300	%	103.10	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	11.10.2016	11.10.2017	33 460 361	CHF	1'049.48	100.00	100.00		0.000	Y
9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.04.2016	18.10.2017	32 149 017	%	99.40		100.00	18.07.	0.000	N
										18.10.	0.000	
4 % Lock-in Multi Defender on Shares- Basket	CHF	1'000.00	23.04.2015	23.10.2017	24 173 344	%	92.60	100.00	100.00	25.04.	0.000	N
										24.10.	0.000	
6.35 % (5.8 % p.a.) Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	23.09.2016	27.10.2017	33 458 540	%	100.90	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.11.2016	09.11.2017	34 182 339	CHF	1'026.51	98.445	100.00	09.12.	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/%	%	%	%	
2.40 % Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	24.11.2016	24.11.2017	34 183 102	%	100.40	100.00	100.00		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.12.2016	15.12.2017	34 837 717	CHF	1'063.42	100.00	100.00		0.000	Y
6.55 % (6.09 % p.a.) Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	25.11.2016	22.12.2017	34 182 735	%	102.10	100.00	100.00		0.000	Y
(Min. 2 % p.a.) Floored Floater with credit risk floating rate note	CHF	1'000.00	01.03.2013	01.03.2018	14 150 456	%	101.10	100.00	100.00	01.03.	5.111	N
										01.06.	5.111	
										01.09.	5.111	
										01.12.	5.055	
(1.95 % min.) Floored Floater with credit risk floating rate	USD	1'000.00	02.05.2013	02.05.2018	14 150 652	%	100.20	100.00	100.00	02.02.	5.029	N
										02.05.	4.656	
										02.08.	4.804	
										02.11.	4.835	
3.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	18.06.2015	18.06.2018	24 173 454	%	94.90	100.00	100.00	20.06.	0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.09.2015	17.09.2018	24 173 666	%	88.60	100.00	100.00	16.03.	0.000	N
										16.06.	0.000	
										16.09.	0.000	
										16.12.	0.000	
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.10.2015	16.10.2018	29 258 000	%	92.60	100.00	100.00	18.01.	0.000	N
										18.04.	0.000	
										18.07.	0.000	
										17.10.	0.000	
(2 3/4 % min.) Floored Floater with reference bond floating rate	EUR	1'000.00	18.10.2013	18.10.2018	14 150 895	%	100.40	100.00	100.00	18.01.	7.609	N
										18.04.	7.585	
										18.07.	7.570	
										18.10.	7.644	
3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.10.2015	23.10.2018	29 257 898	%	95.00	100.00	100.00	25.01.	0.000	N
										25.04.	0.000	
										25.07.	0.000	
										24.10.	0.000	
(1.85 % min.) Floored Floater with reference bond	CHF	1'000.00	05.11.2013	05.11.2018	14 150 961	%	102.30	100.00	100.00	05.02.	4.676	N
										06.05.	4.676	
										06.08.	4.625	
										07.11.	4.830	
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.12.2015	04.12.2018	30 187 767	%	88.80	100.00	100.00	04.03.	0.000	N
										06.06.	0.000	
										05.09.	0.000	
										05.12.	0.000	
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.12.2015	04.12.2018	30 187 763	%	88.40	100.00	100.00	04.03.	0.000	N
										06.06.	0.000	
										05.09.	0.000	
										05.12.	0.000	
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.12.2015	18.12.2018	30 188 208	%	90.40	100.00	100.00	18.03.	0.000	N
										20.06.	0.000	
										19.09.	0.000	
										19.12.	0.000	
(1.7 % min.) Floored Floater Credit Linked on Petrobras	CHF	1'000.00	04.02.2014	04.02.2019	14 151 045	%	98.20	100.00	100.00	04.02.	17.283	N
(3.15 % min.) Floored Floater with reference bond floating rate	USD	1'000.00	25.02.2014	25.02.2019	14 151 105	%	98.40	100.00	100.00	25.02.	7.962	N
										25.05.	7.806	
										25.08.	7.789	
										25.11.	8.156	
5.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.03.2015	04.03.2019	24 173 198	%	80.70	100.00	100.00	04.03.	0.000	N
(1.55 % min.) Floored Floater Credit linked on Newmont Mining Corporation	CHF	1'000.00	19.03.2014	19.03.2019	14 151 132	%	102.00	100.00	100.00	21.03.	3.918	N
										20.06.	3.918	
										19.09.	3.918	
										19.12.	3.918	
Protection Participation on Basket	USD	1'000.00	31.03.2015	31.03.2020	24 173 326	CHF	1'143.39	74.972	100.00		0.000	Y
(1 min.) Structured Note Credit linked on Reference Assets	CHF	1'000.00	07.05.2015	29.04.2020	24 173 324	CHF	975.00	94.847	100.00	29.04.	10.000	Y
Structured Note on Basket	CHF	1'000.00	17.06.2015	17.06.2020	24 173 451	CHF	980.00	95.522	100.00	17.06.	10.000	N
Structured Note on Bonds	CHF	1'000.00	05.11.2014	05.11.2020	24 172 939	%	101.90	100.00	100.00	05.02.	3.159	N
										06.05.	3.159	
										06.08.	3.125	
										07.11.	3.263	

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Liberierungs- bzw. Rückzahlungsdatum Date de libération resp. de remboursement Data della liberazione o del rimborso		Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible 31.12.2016		Bondkomponente Composante obligat. Composante obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2016		a u c
			Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %		Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF					
Structured Note on Basket	EUR	1'000.00	29.04.2015	29.04.2021	24 173 322	%	96.80		100.00	29.01. 29.04. 29.07. 31.10.	4.711 4.717 4.644 4.811	N
Vontobel Financial Products Ltd, Luxemburg												
Underlying Tracker on Volkswagen Vz	EUR	191.27	13.08.2015	26.08.2016	28 406 449		-	99.834	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/%	%	%	%	
Zuercher Kantonalbank Finance (Guernsey) Ltd, Guernsey												
5 % p.a. Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.10.2014	06.10.2016	21 478 057		-	100.00	100.00	06.04. 06.10.	0.155 0.155	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.10.2014	17.10.2016	21 478 098		-	100.00	100.00	18.04. 17.10.	0.18014 0.18014	N
6 % Reverse Convertible on Equities 13.5.2016 Vorzeitige Rückzahlung 13.5.2016 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.08.2015	13.02.2017	28 440 685		-	100.00	100.00	15.02.	0.000	N
5.1 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	29.04.2015	28.04.2017	24 244 260	%	101.10	100.00	100.00	28.01. 28.04. 28.07. 28.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
5.88 % (5 7/8 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.11.2015	30.05.2017	30 513 122	%	100.56	100.00	100.00	30.05. 30.11.	0.000 0.000	N
5.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.07.2015	10.07.2017	28 440 218	%	99.78	100.00	100.00	12.01. 12.04. 11.07. 12.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.07.2016	13.07.2017	32 698 491	%	105.82	100.00	100.00		0.000	N
4 1/2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	19.01.2015	19.07.2017	26 337 469	%	101.93	100.00	100.00	20.01. 19.07.	0.000 0.000	N
4 1/2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	27.01.2015	27.07.2017	26 337 406	%	101.83	100.00	100.00	27.01. 27.07.	0.000 0.000	N
5 1/2 % Callable Barrier Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.08.2014	14.08.2017	21 477 976	%	82.45	100.00	100.00	16.02. 15.08.	0.45991 0.45991	N
4 1/4 % Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	18.08.2016	18.08.2017	32 699 029	%	101.50	100.00	100.00		0.000	Y
3.2 % Callable Barrier Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.09.2014	04.09.2017	21 478 011	%	100.91	100.00	100.00	04.03. 05.09.	0.450 0.450	N
6.4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	18.03.2015	18.09.2017	26 338 113	%	99.12	100.00	100.00	18.03. 19.09.	0.000 0.000	N
4.2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	21.09.2015	21.09.2017	28 440 889	%	100.32	100.00	100.00	21.03. 21.09.	0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	11.10.2016	11.10.2017	33 753 162	%	101.37	100.00	100.00		0.000	Y
7.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.10.2015	16.10.2017	29 551 774	%	101.84	100.00	100.00	18.04. 17.10.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.11.2016	28.11.2017	33 753 896	%	99.54	98.95	100.00		0.000	Y
4.4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	04.12.2014	04.12.2017	24 243 772	%	98.58	100.00	100.00	04.03. 06.06. 05.09. 05.12.	0.09875 0.09875 0.100 0.09875	N
4 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.09.2015	07.09.2018	28 440 736	%	88.12	100.00	100.00	07.03. 07.09.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Euro Stoxx 50- Index	CHF	1'000.00	03.12.2014	03.12.2018	24 243 764	%	96.40	100.00	100.00	03.03. 03.06. 05.09. 05.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N